



RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2020/1224 DE LA COMMISSION

du 16 octobre 2019

complétant le règlement (UE) 2017/2402 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations et les détails d'une titrisation que l'initiateur, le sponsor et la SSPE doivent mettre à disposition

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

Article premier

Définitions

Aux fins du présent règlement, on entend par:

- 1) «entité déclarante»: l'entité désignée en application de l'article 7, paragraphe 2, premier alinéa, du règlement (UE) 2017/2402;
- 2) «date d'arrêté des données»: la date de référence des informations communiquées conformément au présent règlement;
- 3) «exposition sous-jacente active»: une exposition sous-jacente dont, à la date d'arrêté des données, il est attendu qu'elle génère des entrées ou des sorties de trésorerie à l'avenir;
- 4) «exposition sous-jacente inactive»: une exposition sous-jacente en défaut pour laquelle aucun nouveau recouvrement n'est attendu ou qui a fait l'objet d'un remboursement, d'un remboursement par anticipation, d'une annulation, d'un rachat ou d'une substitution;
- 5) «ratio de couverture des charges d'emprunt»: le rapport entre le revenu locatif annuel généré par un bien immobilier commercial qui est totalement ou partiellement financé par un emprunt, déduction faite des impôts et taxes ainsi que des dépenses de fonctionnement engagées pour préserver la valeur du bien, et le montant total annuel des intérêts et des remboursements de capital relatifs à l'endettement total d'un emprunteur sur une période donnée pour le prêt garanti par le bien;
- 6) «ratio de couverture des intérêts»: le rapport entre le revenu locatif annuel brut, avant dépenses de fonctionnement, impôts et taxes, dégagé par un bien immobilier locatif ou le revenu locatif annuel net généré par un bien immobilier commercial ou un ensemble de biens immobiliers, et le coût annuel des intérêts du prêt garanti par le bien ou l'ensemble de biens.

SECTION 1

Informations à mettre à disposition pour toutes les titrisations

Article 2

Informations sur les expositions sous-jacentes

1. Les informations à mettre à disposition pour une titrisation autre qu'ABCP en vertu de l'article 7, paragraphe 1, point a), du règlement (UE) 2017/2402 sont précisées à:

▼B

- a) l'annexe II pour les prêts aux ménages garantis par des biens immobiliers résidentiels, quelle que soit la finalité de ces prêts;
- b) l'annexe III pour les prêts destinés à l'achat de biens immobiliers commerciaux ou garantis par des biens immobiliers commerciaux;
- c) l'annexe IV pour les expositions sous-jacentes sur des entreprises, qui comprennent les expositions sous-jacentes sur des micro, petites et moyennes entreprises;
- d) l'annexe V pour les expositions sous-jacentes automobiles, qui comprennent à la fois les prêts et les contrats de location à des personnes morales ou physiques adossés à des automobiles;
- e) l'annexe VI pour les expositions sous-jacentes sur des prêts à la consommation;
- f) l'annexe VII pour les expositions sous-jacentes sur des cartes de crédit;
- g) l'annexe VIII pour les expositions sous-jacentes sur des contrats de location;
- h) l'annexe IX pour les expositions sous-jacentes qui ne relèvent d'aucune des catégories visées aux points a) à g).

Aux fins du point a), on entend par bien immobilier résidentiel tout bien immobilier disponible à des fins d'habitation (y compris tout logement ou bien immobilier destiné à l'investissement locatif), acquis, construit ou rénové par un ménage et qui ne répond pas aux critères d'un bien immobilier commercial.

Aux fins du point b), on entend par bien immobilier commercial tout bien immobilier, existant ou destiné à la promotion immobilière, qui génère un revenu, à l'exclusion des logements sociaux et des biens immobiliers appartenant à leurs utilisateurs finaux.

2. Lorsqu'une titrisation autre qu'ABCP comprend plusieurs types d'expositions sous-jacentes parmi ceux énumérés au paragraphe 1, l'entité déclarante pour cette titrisation met à disposition les informations visées à l'annexe applicable pour chaque type d'exposition sous-jacente.

3. L'entité déclarante pour une titrisation d'expositions non performantes met à disposition les informations visées:

- a) aux annexes visées au paragraphe 1, points a) à h), selon leur pertinence pour le type d'exposition sous-jacente;
- b) à l'annexe X.

Aux fins du présent paragraphe, une «titrisation d'expositions non performantes» est considérée être une titrisation autre qu'ABCP dont la majorité des expositions sous-jacentes actives, mesurées d'après l'encours de principal à la date d'arrêt des données, sont:

- a) soit des expositions non performantes telles que visées à l'annexe V, partie 2, paragraphes 213 et 239, du règlement d'exécution (UE) n° 680/2014 de la Commission ⁽¹⁾;

⁽¹⁾ Règlement d'exécution (UE) n° 680/2014 de la Commission du 16 avril 2014 définissant des normes techniques d'exécution en ce qui concerne l'information prudentielle à fournir par les établissements, conformément au règlement (UE) n° 575/2013 du Parlement européen et du Conseil (JO L 191 du 28.6.2014, p. 1).

▼B

b) soit des actifs financiers dépréciés tels que définis à l'annexe A de la norme internationale d'information financière 9 dans le règlement (CE) n° 1126/2008 de la Commission ⁽²⁾ ou des actifs financiers comptabilisés comme dépréciés en vertu des règles nationales qui appliquent les principes de comptabilité généralement admis (GAAP) fondés sur la directive 86/635/CEE du Conseil ⁽³⁾.

4. L'entité déclarante pour une transaction ABCP met à disposition les informations visées à l'annexe XI.

5. Aux fins du présent article, les informations à mettre à disposition conformément aux paragraphes 1 à 4 portent sur:

- a) les expositions sous-jacentes actives à la date d'arrêté des données;
- b) les expositions sous-jacentes inactives qui étaient des expositions sous-jacentes actives à la date d'arrêté des données précédente.

*Article 3***▼C1****Informations devant figurer dans les rapports destinés aux investisseurs****▼B**

1. L'entité déclarante pour une titrisation autre qu'ABCP met à disposition les informations sur les rapports destinés aux investisseurs visées à l'annexe XII.

2. L'entité déclarante pour une titrisation ABCP met à disposition les informations sur les rapports destinés aux investisseurs visées à l'annexe XIII.

*Article 4***Granularité des informations**

1. L'entité déclarante met à disposition les informations visées aux annexes II à X et à l'annexe XII sur:

- a) les expositions sous-jacentes, en ce qui concerne chaque exposition sous-jacente individuelle;
- b) les sûretés (collaterals), lorsqu'une des conditions suivantes est remplie et en ce qui concerne chaque élément de sûreté qui garantit chaque exposition sous-jacente:
 - i) l'exposition sous-jacente est couverte par une garantie;
 - ii) l'exposition sous-jacente est couverte par une sûreté physique ou financière;

⁽²⁾ Règlement (CE) n° 1126/2008 de la Commission du 3 novembre 2008 portant adoption de certaines normes comptables internationales conformément au règlement (CE) n° 1606/2002 du Parlement européen et du Conseil (JO L 320 du 29.11.2008, p. 1).

⁽³⁾ Directive 86/635/CEE du Conseil du 8 décembre 1986 concernant les comptes annuels et les comptes consolidés des banques et autres établissements financiers (JO L 372 du 31.12.1986, p. 1).

▼B

- iii) le prêteur peut unilatéralement créer un titre sur l'exposition sous-jacente sans qu'aucune autre approbation ne soit nécessaire de la part du débiteur ou du garant;
- c) les locataires, pour chacun des trois principaux locataires qui occupent un bien immobilier commercial, d'après le loyer annuel total payable par chaque locataire qui occupe le bien;
- d) l'historique des encaissements, pour chaque exposition sous-jacente et pour chaque mois de la période s'étendant de la date d'arrêt des données jusqu'à 36 mois avant ladite date;
- e) les flux de trésorerie, pour chaque élément d'entrée ou de sortie dans la titrisation, comme établi dans la hiérarchie des encaissements ou des décaissements applicable à la date d'arrêt des données;
- f) les tests/événements/déclencheurs, pour chaque test/événement/déclencheur qui entraîne des changements dans la hiérarchie des paiements ou le remplacement de toute contrepartie.

Aux fins des points a) et d), les parties titrisées de prêts sont traitées comme des expositions sous-jacentes individuelles.

Aux fins du point b), chaque bien qui garantit des prêts visés aux points a) et b) de l'article 2, paragraphe 1, est traité comme un élément unique de sûreté.

2. L'entité déclarante met à disposition les informations visées aux annexes XI et XIII sur:

- a) les transactions ABCP, pour toutes les transactions ABCP qui existent dans le programme ABCP à la date d'arrêt des données;
- b) chaque programme ABCP qui finance les transactions ABCP pour lesquelles les informations sont mises à disposition conformément au point a), à la date d'arrêt des données;
- c) les tests/événements/déclencheurs, pour chaque test/événement/déclencheur dans la titrisation ABCP qui entraîne des changements dans la hiérarchie des paiements ou le remplacement de toute contrepartie;
- d) les expositions sous-jacentes, pour chaque transaction ABCP pour laquelle des informations sont mises à disposition conformément au point a), et pour chaque type d'exposition présente dans la transaction ABCP à la date d'arrêt des données, selon la liste figurant dans le champ IVAL5 à l'annexe XI.

SECTION 2

Informations à mettre à disposition pour les titrisations pour lesquelles un prospectus doit être établi (titrisations publiques)

Article 5

Codes d'élément

Les entités déclarantes attribuent des codes d'élément aux informations mises à la disposition des référentiels des titrisations. À cet effet, les entités déclarantes attribuent le code d'élément figurant dans le tableau 3 de l'annexe I qui correspond le mieux à ces informations.

▼B*Article 6***Informations privilégiées**

1. L'entité déclarante pour une titrisation autre qu'ABCP met à disposition les informations privilégiées visées à l'annexe XIV.
2. L'entité déclarante pour une titrisation ABCP met à disposition les informations privilégiées visées à l'annexe XV.

*Article 7***Informations sur les événements importants**

1. L'entité déclarante pour une titrisation autre qu'ABCP met à disposition les informations sur les événements importants visées à l'annexe XIV.
2. L'entité déclarante pour une titrisation ABCP met à disposition les informations sur les événements importants visées à l'annexe XV.

*Article 8***Granularité des informations**

1. L'entité déclarante met à disposition les informations visées à l'annexe XIV sur:
 - a) les tranches/obligations de la titrisation, pour chaque émission de tranches dans la titrisation ou autre instrument auquel un numéro international d'identification des valeurs mobilières ISIN a été attribué et pour chaque prêt subordonné dans la titrisation;
 - b) les comptes, pour chaque compte dans la titrisation;
 - c) les contreparties, pour chaque contrepartie dans la titrisation;
 - d) lorsque la titrisation est une titrisation synthétique autre qu'ABCP:
 - i) la couverture synthétique, pour autant de mécanismes de protection qu'il en existe dans la titrisation;
 - ii) la sûreté de l'émetteur, pour chaque actif individuel constitué en sûreté, et détenu par la SSPE au nom des investisseurs, qui existe pour le mécanisme de protection donné;
 - e) lorsque la titrisation est une titrisation «collateralized loan obligation» (CLO) autre qu'ABCP:
 - i) le gestionnaire de CLO, pour chaque gestionnaire de CLO dans la titrisation;
 - ii) la titrisation CLO.

Aux fins du point d), ii), chaque actif pour lequel existe un numéro international d'identification des valeurs mobilières ISIN est traité comme un actif individuel constitué en sûreté, les sûretés en espèces de la même monnaie sont agrégées et traitées comme un actif individuel constitué en sûreté et les sûretés en espèces de monnaies différentes sont déclarées comme étant des actifs distincts constitués en sûreté.

▼B

2. L'entité déclarante met à disposition les informations visées à l'annexe XV sur:
- a) les transactions ABCP, pour toutes les transactions ABCP qui existent dans le programme ABCP à la date d'arrêt des données;
 - b) les programmes ABCP, pour chaque programme ABCP qui, à la date d'arrêt des données, finance les transactions ABCP sur lesquelles les informations sont mises à disposition conformément au point a);
 - c) les tranches/obligations dans le programme ABCP, pour chaque émission de tranches ou de papier commercial dans le programme ABCP ou autre instrument auquel un numéro international d'identification des valeurs mobilières ISIN a été attribué et pour chaque prêt subordonné dans le programme ABCP;
 - d) les comptes, pour chaque compte dans la titrisation ABCP;
 - e) les contreparties, pour chaque contrepartie dans la titrisation ABCP.

*SECTION 3**Dispositions communes**Article 9***Exhaustivité et cohérence des informations**

1. Les informations mises à disposition en vertu du présent règlement sont complètes et cohérentes.
2. Lorsque l'entité déclarante constate qu'une information qu'elle a mise à disposition en vertu du présent règlement contient des erreurs factuelles, elle met à disposition dans les plus brefs délais une déclaration corrigée de l'ensemble des informations sur la titrisation requises au titre du présent règlement.
3. Lorsque l'annexe correspondante le permet, l'entité déclarante peut déclarer la valeur «Aucune donnée» («ND») parmi les suivantes qui correspondent au motif pour lequel les informations à mettre à disposition ne sont pas disponibles:
- a) la valeur «ND1» lorsque les informations requises n'ont pas été collectées parce que les critères de prêt ou de souscription ne l'exigeaient pas au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente;
 - b) la valeur «ND2» lorsque les informations requises ont été collectées au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente mais qu'elles ne sont pas chargées dans le système de déclaration de l'entité déclarante à la date d'arrêt des données;
 - c) la valeur «ND3» lorsque les informations requises ont été collectées au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente mais qu'elles sont chargées dans un système distinct du système de déclaration de l'entité déclarante à la date d'arrêt des données;

▼B

- d) la valeur «ND4-AAAA-MM-JJ» lorsque les informations requises ont été collectées mais qu'il ne sera possible de les mettre à disposition qu'à une date ultérieure à la date d'arrêté des données. Les lettres «AAAA-MM-JJ» font respectivement référence aux chiffres de l'année, du mois et du jour correspondant à la date future à laquelle les informations requises seront mises à disposition;
- e) la valeur «ND5» lorsque les informations requises sont sans objet pour l'élément qui fait l'objet de la déclaration.

Aux fins du présent paragraphe, la déclaration de toute valeur ND ne doit pas être utilisée pour contourner les exigences du présent règlement.

Sur demande des autorités compétentes, l'entité déclarante fournit des détails sur les circonstances qui justifient l'emploi de ces valeurs ND.

*Article 10***Actualité des informations**

1. Lorsqu'une titrisation n'est pas une titrisation ABCP, la date d'arrêté des données pour les informations mises à disposition conformément au présent règlement est fixée au plus tard à deux mois civils avant la date de transmission.
2. Lorsqu'une titrisation est une titrisation ABCP:
 - a) la date d'arrêté des données pour les informations visées à l'annexe XI et à la section «informations sur la transaction» des annexes XIII et XV est fixée au plus tard à deux mois civils avant la date de transmission;
 - b) la date d'arrêté des données pour les informations visées dans toutes les sections des annexes XIII et XV autres que la section «informations sur la transaction» est fixée au plus tard à un mois civil avant la date de transmission.

*Article 11***Identifiants uniques**

1. Chaque titrisation se voit attribuer un identifiant unique composé des éléments suivants, apparaissant dans un ordre séquentiel:
 - a) l'identifiant d'entité juridique de l'entité déclarante;
 - b) la lettre «A» lorsqu'il s'agit d'une titrisation ABCP ou la lettre «N» lorsqu'il s'agit d'une titrisation autre qu'ABCP;
 - c) les quatre chiffres de l'année correspondant à:
 - i) l'année d'émission des premiers titres de la titrisation lorsqu'il s'agit d'une titrisation autre qu'ABCP;
 - ii) l'année d'émission des premiers titres au sein du programme ABCP lorsqu'il s'agit d'une titrisation ABCP;

▼B

- d) le nombre 01 ou, lorsque plusieurs titrisations ont le même identifiant tel que visé aux points a), b) et c), un numéro séquentiel à deux chiffres qui correspond à l'ordre dans lequel les informations sur chaque titrisation sont mises à disposition. L'ordre des titrisations simultanées est libre.
2. Chaque transaction ABCP au sein d'un programme ABCP se voit attribuer un identifiant unique composé des éléments suivants, apparaissant dans un ordre séquentiel:
- a) l'identifiant d'entité juridique de l'entité déclarante;
- b) la lettre «T»;
- c) les quatre chiffres de l'année correspondant à la première date de clôture de la transaction ABCP;
- d) le nombre 01 ou, lorsque plusieurs transactions ABCP ont le même identifiant tel que visé aux points a), b) et c) du présent paragraphe, un numéro séquentiel à deux chiffres qui correspond à l'ordre de la première date de clôture de chaque transaction ABCP. L'ordre des transactions ABCP simultanées est libre.
3. L'entité déclarante ne modifie pas les identifiants uniques.

*Article 12***Déclaration des classements**

1. Les informations relatives au classement dans la nomenclature du système européen de comptes 2010 (SEC 2010) visé dans le règlement (UE) n° 549/2013 du Parlement européen et du Conseil⁽⁴⁾ sont mises à disposition en utilisant les codes indiqués dans le tableau 1 de l'annexe I.
2. Les informations relatives aux classements dans la liste de surveillance des organes de gestion sont mises à disposition en utilisant les codes indiqués dans le tableau 2 de l'annexe I.

*Article 13***Entrée en vigueur**

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

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

⁽⁴⁾ Règlement (UE) n° 549/2013 du Parlement européen et du Conseil du 21 mai 2013 relatif au système européen des comptes nationaux et régionaux dans l'Union européenne (JO L 174 du 26.6.2013, p. 1).

▼B

ANNEXE I

Tableau 1: Codes sécurisés du système européen des comptes

Secteurs	Sous-secteurs	Code SEC
Sociétés non financières	Sociétés non financières publiques	S.11001
	Sociétés non financières privées nationales	S.11002
	Sociétés non financières sous contrôle étranger	S.11003
Institutions financières monétaires (IFM)	Banque centrale	S.121
	Institutions de dépôt publiques, à l'exclusion de la banque centrale	S.12201
	Institutions de dépôt privées nationales, à l'exclusion de la banque centrale	S.12202
	Institutions de dépôt sous contrôle étranger, à l'exclusion de la banque centrale	S.12203
	Fonds d'investissement monétaires publics	S.12301
	Fonds monétaires privés nationaux	S.12302
	Fonds monétaires sous contrôle étranger	S.12303
Sociétés financières, à l'exclusion des IFM et des sociétés d'assurance et fonds de pension (SAFP)	Fonds d'investissement non monétaires publics	S.12401
	Fonds d'investissement non monétaires privés nationaux	S.12402
	Fonds d'investissement non monétaires sous contrôle étranger	S.12403
	Autres intermédiaires financiers publics, à l'exclusion des sociétés d'assurance et des fonds de pension	S.12501
	Autres intermédiaires financiers privés nationaux, à l'exclusion des sociétés d'assurance et des fonds de pension	S.12502
	Autres intermédiaires financiers sous contrôle étranger, à l'exclusion des sociétés d'assurance et des fonds de pension	S.12503
	Auxiliaires financiers publics	S.12601
	Auxiliaires financiers privés nationaux	S.12602
	Auxiliaires financiers sous contrôle étranger	S.12603
	Institutions financières captives et prêteurs non institutionnels publics	S.12701
	Institutions financières captives et prêteurs non institutionnels privés nationaux	S.12702
	Institutions financières captives et prêteurs non institutionnels sous contrôle étranger	S.12703

▼ **B**

Secteurs	Sous-secteurs	Code SEC
SAFP	Sociétés d'assurance publiques	S.12801
	Sociétés d'assurance privées nationales	S.12802
	Sociétés d'assurance sous contrôle étranger	S.12803
	Fonds de pension publics	S.12901
	Fonds de pension privés nationaux	S.12902
	Fonds de pension sous contrôle étranger	S.12903
Autres	Administrations publiques	S.13
	Administration centrale (à l'exclusion des administrations de sécurité sociale)	S.1311
	Administrations d'États fédérés (à l'exclusion des administrations de sécurité sociale)	S.1312
	Administrations locales (à l'exclusion des administrations de sécurité sociale)	S.1313
	Administrations de sécurité sociale	S.1314
	Ménages	S.14
	Employeurs et travailleurs indépendants	S.141 + S.142
	Salariés	S.143
	Bénéficiaires de revenus de biens immobiliers et de transferts	S.144
	Bénéficiaires de revenus de biens immobiliers	S.1441
	Bénéficiaires de pensions	S.1442
	Bénéficiaires d'autres transferts	S.1443
	Institutions sans but lucratif au service des ménages	S.15
	États membres de l'Union européenne	S.211
	Institutions et organes de l'Union européenne	S.212
Pays non membres de l'Union européenne et organisations internationales non résidentes de l'Union européenne	S.22	

Tableau 2: Codes de la liste de surveillance des organes de gestion

Code de la liste de surveillance des organes de gestion	Signification	Seuil d'inscription	Seuil de sortie
1A	Retard dans le versement couvrant le capital et les intérêts	Deux paiements en souffrance	Arriérés apurés et prêt en cours. Demeure sur la liste de surveillance pendant deux trimestres/périodes
1B	Incident de prorogation d'assurance ou assurance imposée	30 jours de retard	Réception d'une preuve d'assurance satisfaisante

▼ B

Code de la liste de surveillance des organes de gestion	Signification	Seuil d'inscription	Seuil de sortie
1C	Ratio de couverture des intérêts inférieur à l'excédent de dividende	Ratio de couverture des intérêts < convention de prêt requise (excédent de trésorerie ou niveau par défaut); Ratio de couverture des intérêts < 1,00 au cas par cas	Ratio de couverture des intérêts supérieur au seuil
1D	Niveau absolu du ratio de couverture des charges d'emprunt	Ratio de couverture des charges d'emprunt < 1,00 Ratio de couverture des charges d'emprunt < 1,20 pour les bâtiments hospitaliers et les habitations ou au cas par as	Ratio de couverture des charges d'emprunt supérieur au seuil
1E	Ratio de couverture des charges d'emprunt diminuée à compter de la date de titrisation	Ratio de couverture des charges d'emprunt < 80 % du ratio de couverture des charges d'emprunt à la date de titrisation	Ratio de couverture des charges d'emprunt supérieur au seuil Demeure sur la liste de surveillance pendant deux trimestres/périodes
1F	En défaut, arrivé à échéance ou découverte d'un précédent privilège subordonné non déclaré, y compris un prêt mezzanine	Lorsque l'organe de gestion en est informé	Le défaut de paiement a été corrigé ou la dette subordonnée est approuvée par l'organe de gestion
1G	Tout prélèvement non prévu sur une lettre de crédit, sur la réserve pour les charges d'emprunt ou sur les fonds de roulement pour payer les charges d'emprunt	Survenance au cas par cas	Après le remplacement des fonds ou de la lettre de crédit si les documents l'exigent, sinon après deux dates de paiement des intérêts sans prélèvement complémentaire
2A	Réparations impératives réservées à la clôture, ou déclarées d'une quelconque autre manière à l'organe de gestion, mais non achevées à la date prévue	Si la réparation requise n'est pas achevée dans les 60 jours suivant la date prévue (y compris les prolongations approuvées par l'organe de gestion) et correspond au montant le plus faible entre 10 % du solde du capital non versé ou 250 000 EUR	Vérification satisfaisante de l'achèvement des réparations
2B	Toute lacune dans le plan de dépenses requis [par exemple, dépenses d'investissement, FF&E (mobilier, aménagements et équipements)]	Toute information concernant une lacune qui affecte négativement la performance ou la valeur du bien; au cas par cas/significativement (> 5 % de l'encours du prêt)	Lorsque les lacunes du plan sont corrigées
2C	Survenance d'un événement déclencheur dans les documents du prêt hypothécaire (par exemple, remboursement du prêt requis, fourniture de réserves supplémentaires, seuils minimums enfreints, etc.)	Survenance d'un événement	Résolution de l'événement qui nécessitait une action en vertu des documents du prêt hypothécaire

▼ B

Code de la liste de surveillance des organes de gestion	Signification	Seuil d'inscription	Seuil de sortie
2D	Vérification de la performance financière. Calendrier de location ou compte d'exploitation, etc., non satisfaisant ou non fourni	Survenance pendant six mois ou plus	Résolution de l'événement qui nécessitait une action en vertu des documents du prêt hypothécaire
2E	Manquement à la licence d'exploitation ou à l'accord de franchise	Lorsque l'organe de gestion en est informé	Nouvelle franchise ou licence en place, ou correction du manquement à la licence d'exploitation ou à l'accord de franchise – accord établissant des relations
2F	Faillite de l'emprunteur/propriétaire/sponsor ou événement similaire [par exemple, accord/procédures d'insolvabilité, faillite, administration judiciaire, liquidation, procédure de concordat (société/entreprise individuelle), fait l'objet d'un ordre de liquidation, d'une demande de placement en faillite ou autre procédure]	Lorsque l'organe de gestion en est informé	Demeure sur la liste de surveillance jusqu'à la date de paiement des intérêts après la résolution de l'événement
3A(i)	L'inspection révèle un mauvais état	Survenance au cas par cas/significative (5 % > du revenu locatif net)	Les lacunes au niveau du bien sont corrigées ou l'accès est autorisé et l'inspection est achevée, à la discrétion de l'organe de gestion
3A(ii)	L'inspection révèle une mauvaise accessibilité	Survenance au cas par cas/significative (5 % > du revenu locatif net)	Les lacunes au niveau du bien sont corrigées ou l'accès est autorisé et l'inspection est achevée, à la discrétion de l'organe de gestion
3B	L'inspection révèle un problème environnemental dangereux	Survenance d'un événement	Correction des lacunes au niveau du bien à la discrétion de l'organe de gestion
3C	Biens affectés par un accident majeur ou une procédure d'expropriation modifiant les futurs flux de trésorerie, la valeur/dépréciation/caution	Lorsque l'organe de gestion prend connaissance du problème et que ce dernier affecte 10 % de la valeur ou 500 000 EUR	Toutes les réparations nécessaires ont été exécutées de manière satisfaisante ou la procédure d'expropriation a été close et l'actif peut donner des résultats satisfaisants, à la discrétion de l'organe de gestion
4A	Diminution du taux d'occupation global du portefeuille de biens	20 % de moins que le niveau à la date de titrisation; au cas par cas	Lorsque la situation n'existe plus
4B	Un locataire ou une combinaison des TROIS PRINCIPAUX LOCATAIRES (sur la base du loyer brut) dont les contrats de location représentent > 30 % expirent dans les 12 prochains mois	Applicable uniquement aux immeubles de bureau, industriels et de commerce de détail	Lorsque la situation n'existe plus ou à la discrétion de l'organe de gestion

▼ B

Code de la liste de surveillance des organes de gestion	Signification	Seuil d'inscription	Seuil de sortie
4C	Contrats de location importants non respectés, résiliés ou portant sur des biens inoccupés, mais dont le loyer est versé	> 30 % du revenu locatif net	Lorsque la situation n'existe plus ou à la discrétion de l'organe de gestion
5A	Échéance du prêt imminente	< 180 jours jusqu'à l'échéance	Remboursement du prêt

Tableau 3: Types et codes des éléments

Type d'élément	Article(s) du règlement (UE) 2017/2402	Code de l'élément
Expositions sous-jacentes, créances sous-jacentes ou créances privées sous-jacentes	7, paragraphe 1, point a)	1
Rapport destiné aux investisseurs	7, paragraphe 1, point e)	2
Document d'offre final, prospectus, documents relatifs à la clôture de l'opération, à l'exclusion des avis juridiques	7, paragraphe 1, point b) i)	3
Accord de vente, de cession, de novation ou de transfert d'actifs, et toute notification de fiducie pertinente	7, paragraphe 1, point b) ii)	4
Contrats dérivés et accords de garantie, tout document pertinent sur la couverture par des sûretés lorsque les expositions qui sont titrisées restent des expositions de l'initiateur	7, paragraphe 1, point b) iii)	5
Contrats de gestion, de gestion de support, d'administration et de gestion des flux de trésorerie	7, paragraphe 1, point b) iv)	6
Acte de fiducie ou de trust, acte de garantie, contrat d'agence, accord bancaire de compte, contrat d'investissement garanti, termes intégrés ou convention de fiducie globale ou convention de définition de la fiducie, ou tout document juridique d'une valeur légale équivalente	7, paragraphe 1, point b) v)	7
Accords intercréanciers, documentation relative aux produits dérivés, accords de prêt subordonné, de prêt au démarrage et de facilité de trésorerie pertinents	7, paragraphe 1, point b) vi)	8
Toute autre documentation sous-jacente essentielle à la compréhension de l'opération	7, paragraphe 1, point b)	9
Notification simple, transparente et standardisée en vertu de l'article 27 du règlement (UE) 2017/2402	7, paragraphe 1, point d)	10
Informations privilégiées relatives à la titrisation que l'initiateur, le sponsor ou la SSPE a l'obligation de rendre publique conformément à l'article 17 du règlement (UE) n° 596/2014 du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾	7, paragraphe 1, point f)	11

▼ B

Type d'élément	Article(s) du règlement (UE) 2017/2402	Code de l'élément
Un événement important, tel que: <ul style="list-style-type: none"> i) un manquement significatif aux obligations prévues dans les documents rendus disponibles en application de l'article 7, paragraphe 1, point b), du règlement (UE) 2017/2402, y compris tout recours, toute dérogation ou tout consentement ultérieur en rapport avec un tel manquement ii) une modification des caractéristiques structurelles susceptible d'influencer de manière significative la performance de la titrisation iii) une modification des caractéristiques de risque de la titrisation ou des expositions sous-jacentes susceptible d'influencer de manière significative la performance de la titrisation iv) dans le cas de titrisations STS, le fait que la titrisation cesse de satisfaire aux exigences STS ou que les autorités compétentes ont pris des mesures correctives ou administratives v) toute modification significative apportée aux documents concernant l'opération 	7, paragraphe 1, point g)	12
(1) Règlement (UE) n° 596/2014 du Parlement européen et du Conseil du 16 avril 2014 sur les abus de marché (règlement relatif aux abus de marché) et abrogeant la directive 2003/6/CE du Parlement européen et du Conseil et les directives 2003/124/CE, 2003/125/CE et 2004/72/CE de la Commission (JO L 173 du 12.6.2014, p. 1).		



ANNEXE II

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – IMMOBILIER RÉSIDENTIEL (RRE)

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
RREL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) de la Commission 2020/1224 (1).	NON	NON
RREL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ RREL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ RREL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ RREL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ RREL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
RREL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
RREL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI
RREL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL10	Résident	Le débiteur principal est-il résident du pays dans lequel sont situées la sûreté et l'exposition sous-jacente?	OUI	NON
RREL11	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
RREL12	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
RREL13	Situation professionnelle	Situation professionnelle du débiteur principal: Salarié – secteur privé (EMRS) Salarié – secteur public (EMBL) Salarié – secteur inconnu (EMUK) Sans emploi (UNEM) Travailleur indépendant (SFEM) Aucun emploi, le débiteur est une entité juridique (NOEM) Étudiant (STNT) Retraité (PNNR) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREL14	Débiteur en difficulté	Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial: a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p> <p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
RREL15	Type de client	<p>Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO)</p> <p>Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (ENEO)</p> <p>Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO)</p> <p>Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
RREL16	Revenu principal	<p>Revenu annuel du débiteur principal utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer les recettes annuelles de ce débiteur.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL17	Type de revenu principal	Indiquer le revenu affiché dans le champ RREL16: Revenu brut annuel (GRAN) Revenu net annuel (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (NITS) Revenu net annuel (net d'impôts uniquement) (NITX) Revenu net annuel (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (NITN) Revenu net annuel estimé (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (ENIS) Revenu net annuel estimé (net d'impôts uniquement) (EITX) Revenu net annuel estimé (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (EISS) Revenu disponible (DSPL) L'emprunteur est une entité juridique (CORP) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREL18	Monnaie du revenu principal	Devise dans laquelle le revenu ou les recettes du débiteur principal est/sont versé(es).	OUI	NON
RREL19	Vérification du revenu principal	Vérification du revenu principal: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREL20	Revenus secondaires	Revenu annuel du débiteur secondaire utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur secondaire est une personne morale/entité juridique, entrer les recettes annuelles de ce débiteur. S'il y a plus de deux débiteurs pour cette exposition sous-jacente, indiquer le revenu total annuel combiné de tous les débiteurs dans ce champ. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
RREL21	Vérification des revenus secondaires	Vérification du revenu pour le revenu secondaire: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL22	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
RREL23	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
RREL24	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI
RREL25	Durée initiale du prêt	Durée contractuelle initiale (en nombre de mois) à la date d'initiation.	OUI	OUI
RREL26	Canal à l'origine de l'initiation	Canal à l'origine de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Siège ou réseau d'agences (BRAN) Central ou direct (DRCT) Courtier (BROK) Internet (WEBI) Programme (TPAC) Canal tiers, mais souscription réalisée entièrement par l'initiateur (TPTC) Autre (OTHR)	OUI	OUI
RREL27	Finalité	Raison pour laquelle le débiteur souscrit le prêt: Achat (PURC) Refinancement hypothécaire (RMRT) Rénovation (RENV) Hypothèque rechargeable (EQRE) Construction (CNST) Consolidation de dette (DCON) Refinancement avec hypothèque rechargeable (RMEQ) Financement d'entreprises (BSFN) Prêt hypothécaire combiné (CMRT) Prêt hypothécaire pour investissement (IMRT) Droit d'acheter (RGBY) Prêt soutenu par le gouvernement (GSPL) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREL28	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
RREL29	Encours initial du capital	Encours initial de l'exposition sous-jacente (commissions incluses). Il s'agit de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL30	Encours actuel du capital	<p>Montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêté des données. Ce montant inclut tous les montants garantis par l'hypothèque et sera assimilé au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités.</p> <p>L'encours actuel inclut les impayés sur le capital. Toutefois, le montant de l'épargne doit être déduit en cas de sous-participation (à savoir, encours de l'exposition sous-jacente = exposition sous-jacente +/- sous-participation; +/- 0 s'il n'y a pas de sous-participation).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL31	Soldes de principal de rang supérieur	<p>Soldes de principal de rang supérieur à cette exposition sous-jacente (y compris ceux détenus par d'autres prêteurs). S'il n'y a pas de solde de rang supérieur, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
RREL32	Expositions sous-jacentes de rang égal	<p>Valeur totale des expositions sous-jacentes de ce débiteur de rang égal à cette exposition sous-jacente (qu'elles soient comprises ou non dans ce panier). S'il n'y a pas de solde de rang égal, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
RREL33	Montant limite du crédit	<p>Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles (y compris celles présentant des caractéristiques de prêt revolving) ou lorsque le montant maximal de l'exposition sous-jacente n'a pas été retiré en totalité: montant potentiel maximal de l'encours d'exposition.</p> <p>Ce champ ne doit être rempli que pour les expositions sous-jacentes présentant des caractéristiques de prélèvements flexibles ou complémentaires.</p> <p>Il ne s'agit pas de tenir compte des cas où le débiteur peut renégocier une augmentation de l'encours de l'exposition sous-jacente, mais plutôt des cas où, en vertu du contrat, le débiteur a la possibilité de le faire et le prêteur, de fournir le financement supplémentaire.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL34	Prix d'achat	<p>Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL35	Type d'amortissement	Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts: Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX) Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX) Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE) In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREL36	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
RREL37	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
RREL38	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
RREL39	Prochain paiement dû	Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
RREL40	Ratio de la dette au revenu	Dette définie en tant que montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêt des données. Ce montant inclut tous les montants garantis par l'hypothèque et sera assimilé au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital pour la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités. Revenu défini en tant que revenu combiné, somme des champs «Revenu principal» et «Revenu secondaire» (numéros de champs RREL16 et RREL20) et de tout autre revenu.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL41	Montant libératoire	Montant total du remboursement du capital (titrisé) à effectuer à la date d'échéance de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
RREL42	Type de taux d'intérêt	Type de taux d'intérêt: Exposition sous-jacente à taux variable (permanent) (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable liée à un indice qui passera à un autre indice dans l'avenir (FINX) Exposition sous-jacente à taux fixe (permanent) (FXRL) Taux fixe avec de futures révisions périodiques (FXPR) Exposition sous-jacente à taux fixe avec un futur passage obligatoire à un taux variable (FLCF) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plafond (CAPP) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher et une valeur plafond (FLIF) Taux d'actualisation (DISC) Option de modification (SWIC) Échange entre débiteurs (OBLS) Modulaire (MODE) Autre (OTHR)	NON	OUI
RREL43	Taux d'intérêt actuel	Taux brut annuel utilisé pour calculer les intérêts sur la période courante de l'échéancier de l'exposition sous-jacente titrisée. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI
RREL44	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
RREL45	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
RREL46	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI
RREL47	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL48	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
RREL49	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
RREL50	Marge à la révision 1	Marge pour l'exposition sous-jacente à la première date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI
RREL51	Date 1 de révision des intérêts	Prochaine date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI
RREL52	Marge à la révision 2	Marge pour l'exposition sous-jacente à la deuxième date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI
RREL53	Date 2 de révision des intérêts	Deuxième date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI
RREL54	Marge à la révision 3	Marge pour l'exposition sous-jacente à la troisième date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI
RREL55	Date 3 de révision des intérêts	Troisième date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL56	Indice de référence du taux d'intérêt révisé	Prochain indice du taux d'intérêt: MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
RREL57	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt révisé	Échéance du prochain indice de référence du taux d'intérêt: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI)	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)		
RREL58	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
RREL59	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI
RREL60	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
RREL61	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le non-paiement d'intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Ce montant inclut les montants encaissés qui n'ont pas été titrisés. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
RREL62	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
RREL63	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
RREL64	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêt des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
RREL65	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
RREL66	Date du dernier arriéré	Date à laquelle l'exposition sous-jacente présentait son dernier arriéré.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL67	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
RREL68	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêt des données.	NON	NON
RREL69	Situation du compte	Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée: Performante (PERF) Restructurée – aucun arriéré (RNAR) Restructurée – arriérés (RARR) En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT) Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT) En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR) En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB) Arriérés (ARRE) Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR) Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF) Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE) Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS) Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT) Remboursée (RDMD) Autre (OTHR) «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL70	Raison du défaut ou de la saisie	<p>Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée:</p> <p>En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX)</p> <p>En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX)</p> <p>En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)</p>	OUI	OUI
RREL71	Montant du défaut	<p>Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL72	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
RREL73	Pertes allouées	<p>Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL74	Recouvrements cumulés	<p>Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL75	Contentieux	Indique l'existence d'une procédure de mise au contentieux. Si le compte a été recouvré et qu'il n'existe plus de contentieux en cours, indiquer «N».	NON	OUI
RREL76	Recours	Y a-t-il recours (complet ou limité) aux actifs du débiteur au-delà du produit réalisé d'une sûreté pour cette exposition sous-jacente?	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL77	Montant des dépôts	<p>Somme de tous les montants du débiteur détenus par l'initiateur ou le vendeur qui sont potentiellement déductibles de l'encours de l'exposition sous-jacente, à l'exclusion du bénéfice découlant de tout système national de garantie des dépôts. Afin d'empêcher une double comptabilisation, cette somme doit être plafonnée au plus faible 1) du montant des dépôts et 2) du montant maximal potentiellement déductible au niveau du débiteur (et non au niveau de l'exposition sous-jacente) dans le panier.</p> <p>Utiliser la même devise de libellé que celle utilisée pour cette exposition sous-jacente.</p> <p>Si un débiteur a plus d'un encours dans le panier, alors ce champ doit être complété pour chaque exposition sous-jacente et la décision de répartir le montant des dépôts entre chacune d'entre elles est laissée à la discrétion de l'entité déclarante, sous réserve du plafond susmentionné et aussi longtemps que la somme des entrées de ce champ pour les multiples expositions sous-jacentes est égale à ce montant précis. Par exemple, si un débiteur A a un solde de dépôts de 100 EUR et deux encours dans le panier de: 60 EUR (exposition sous-jacente 1) et de 75 EUR (exposition sous-jacente 2), ce champ doit être complété soit par «exposition sous-jacente 1 – 60 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 40 EUR», soit par «exposition sous-jacente 1 – 25 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 75 EUR» (c'est-à-dire, les entrées relatives de ce champ pour chaque exposition sous-jacente sont plafonnées à 60 EUR pour l'exposition sous-jacente 1 et à 75 EUR pour l'exposition sous-jacente 2 et la somme des valeurs de l'exposition sous-jacente 1 et de l'exposition sous-jacente 2 doit être égale à 100 EUR).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
RREL78	Fournisseur de l'assurance ou de l'investissement	Nom de l'assurance ou de l'investissement (c'est-à-dire, pour les expositions sous-jacentes d'assurance-vie ou d'investissement).	OUI	OUI
RREL79	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
RREL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
RREL81	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREL82	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
RREL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
RREL84	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON

Informations au niveau de la sûreté

RREC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ RREL1.	NON	NON
RREC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de chaque exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre au champ RREL3.	NON	NON
RREC3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREC4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ RREC2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ RREC2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
RREC5	Type de sûreté	Principal type d'actif (en termes de valeur) garantissant la dette. Dans le cas de garanties adossées à des sûretés physiques ou financières, se baser sur toutes les sûretés sur lesquelles la garantie est adossée. Automobile (CARX) Véhicule industriel (INDV) Camion commercial (CMTR) Véhicule ferroviaire (RALV) Véhicule nautique commercial (NACM) Véhicule nautique de loisir (NALV) Avion (AERO) Machine-outil (MCHT)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Équipement industriel (INDE)</p> <p>Équipement de bureau (OFEQ)</p> <p>Équipement informatique (ITEQ)</p> <p>Équipement médical (MDEQ)</p> <p>Équipement lié à l'énergie (ENEQ)</p> <p>Bâtiment commercial (CBLD)</p> <p>Bâtiment résidentiel (RBLD)</p> <p>Bâtiment industriel (IBLD)</p> <p>Autre véhicule (OTHV)</p> <p>Autre équipement (OTHE)</p> <p>Autre bien immobilier (OTRE)</p> <p>Autres produits ou stocks (OTGI)</p> <p>Titres (SECU)</p> <p>Garantie (GUAR)</p> <p>Autre actif financier (OTFA)</p> <p>Catégories mixtes correspondant à une sûreté constituée sur tous les actifs du débiteur (MIXD)</p> <p>Autre (OTHR)</p>		
RREC6	Région géographique – Sûreté	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est située la sûreté physique Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
RREC7	Type d'occupation	<p>Type d'occupation du bien:</p> <p>Occupé par le propriétaire, c'est-à-dire, détenu par un ménage privé afin de fournir un abri à son propriétaire (FOWN)</p> <p>Partiellement occupé par le propriétaire (un bien partiellement loué) (POWN)</p> <p>Non occupé par le propriétaire ou investissement locatif (TLET)</p> <p>Maison de vacances ou résidence secondaire (HOLD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.</p>	OUI	OUI
RREC8	Privilège	<p>Position de privilège la plus élevée détenue par l'initiateur en ce qui concerne la sûreté.</p> <p>Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREC9	Type de bien	Type de bien: Résidentiel (maison, individuelle ou jumelée) (RHOS) Résidentiel (appartement) (RFLT) Résidentiel (pavillon) (RGLB) Résidentiel (maison en rangée) (RTHS) Maison multifamilles (biens avec plus de quatre unités garantissant une seule exposition sous-jacente) (MULF) Utilisation commerciale partielle (bien utilisé à titre de résidence et pour une utilisation commerciale, dont moins de 50 % de la valeur est dérivée de son utilisation commerciale, par exemple maison et cabinet d'un médecin) (PCMM) Utilisation commerciale ou professionnelle (BIZZ) Terrain uniquement (LAND) Autre (OTHR) Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
RREC10	Valeur du certificat de performance énergétique	Valeur du certificat de performance énergétique de la sûreté au moment de l'initiation: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE) F (EPCF) G (EPCG) Autre (OTHR)	OUI	OUI
RREC11	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur du certificat de performance énergétique. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
RREC12	Ratio actuel prêt/valeur	Ratio prêt/valeur actuel (LTV). Pour les prêts avec privilèges de second rang, il s'agit du ratio prêt/valeur combiné ou total. Lorsque l'encours du prêt est négatif, entrer 0. Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREC13	Montant de la valorisation actuelle	<p>Valorisation la plus récente de la sûreté telle qu'estimée par un expert indépendant externe ou interne. Dans le cas où une telle estimation n'est pas disponible, la valeur actuelle de la sûreté peut être estimée à l'aide d'un indice de la valeur des biens immobiliers suffisamment détaillé en ce qui concerne l'emplacement géographique et le type de la sûreté; si un tel indice n'est pas disponible non plus, un indice des prix de l'immobilier suffisamment détaillé en ce qui concerne l'emplacement géographique et le type de la sûreté peut être utilisé après application d'une décote choisie de manière appropriée pour tenir compte de la dépréciation de la sûreté.</p> <p>Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer sa plus récente valorisation telle qu'estimée par un expert indépendant externe ou interne, ou, si elle n'est pas disponible, par l'initiateur.</p> <p>Si la sûreté déclarée est une garantie, entrer le montant de l'exposition sous-jacente garantie par cette sûreté spécifique au profit de l'initiateur.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
RREC14	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	<p>Méthode de calcul de la valeur la plus récente de la sûreté, telle qu'indiquée dans le champ RREC13:</p> <p>Inspection complète, interne et externe (FIEI)</p> <p>Inspection complète, uniquement externe (FOEI)</p> <p>Inspection rapide (DRVB)</p> <p>Modèle de valorisation automatisé (AUVM)</p> <p>Indexée (IDXN)</p> <p>Par ordinateur (DKTP)</p> <p>Mandataire ou agent immobilier (MAEA)</p> <p>Autorité fiscale (TXAT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
RREC15	Date de valorisation actuelle	Date de la valorisation la plus récente, comme indiqué dans le champ RREC13.	OUI	OUI
RREC16	Ratio initial prêt/valeur	<p>Ratio prêt/valeur (LTV) initial du prêt souscrit par l'initiateur. Pour les prêts avec privilèges de second rang, il s'agit du ratio prêt/valeur combiné ou total.</p> <p>Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.</p>	OUI	OUI
RREC17	Montant de la valorisation initiale	<p>Valorisation initiale de la sûreté utilisée lors de l'initiation de l'exposition sous-jacente (c'est-à-dire, avant la titrisation).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
RREC18	Méthode suivie pour la valorisation initiale	Méthode de calcul de la valeur de la sûreté au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente, telle qu'indiquée dans le champ RREC17: Inspection complète, interne et externe (FIEI) Inspection complète, uniquement externe (FOEI) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM) Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire/agent immobilier (MAEA) Autorité fiscale (TXAT) Autre (OTHR)	OUI	NON
RREC19	Date de la valorisation initiale	Date de la valorisation initiale de la sûreté, comme indiqué dans le champ RREC17.	OUI	NON
RREC20	Date de la vente	Date de la vente de la sûreté saisie.	OUI	OUI
RREC21	Prix de vente	Prix réalisé sur la vente de la sûreté en cas de saisie. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
RREC22	Monnaie de la sûreté	Il s'agit de la devise dans laquelle le montant de la valorisation indiquée dans le champ RREC13 est libellé.	NON	OUI
RREC23	Type de garant	Type de garant: Aucun garant (NGUA) Particulier – relation familiale (FAML) Particulier – autre (IOTH) Gouvernement (GOVE) Banque (BANK) Produit d'assurance (INSU) Système de garantie «Nationale Hypotheek Garantie» (NHGX) Fonds de Garantie de l'Accession Sociale (FGAS) Caution (CATN) Autre (OTHR)	OUI	NON

(¹) Règlement délégué (UE)2020/1224 de la Commission du 16 octobre 2019 complétant le règlement (UE) 2017/2402 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations et les détails d'une titrisation à communiquer par l'initiateur, le sponsor et la SSPE (JO L 289 du 3.9.2020, p. 1).



ANNEXE III

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – IMMOBILIER COMMERCIAL (CRE)

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
CREL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
CREL2	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREL3	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ CREL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CREL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREL4	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREL5	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ CREL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CREL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
CREL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL8	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
CREL9	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI
CREL10	Date de substitution	Si une exposition sous-jacente a été substituée par une autre exposition sous-jacente après la date de titrisation, indiquer la date de cette substitution.	NON	OUI
CREL11	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI
CREL12	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
CREL13	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
CREL14	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
CREL15	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CREL16	Date de début de l'amortissement	Date à laquelle commencera l'amortissement sur l'exposition sous-jacente (cette date peut être antérieure à la date de titrisation).	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL17	Date d'échéance du prêt à la date de titrisation	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente telle que définie dans le contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Cette date ne tient pas compte de toute prolongation de la date d'échéance qui pourrait être autorisée dans le cadre du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL18	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI
CREL19	Durée initiale du prêt	Durée contractuelle initiale (en nombre de mois) à la date d'initiation.	OUI	OUI
CREL20	Durée de l'option de prolongation	Durée en mois de toute option de prolongation des échéances disponible pour l'exposition sous-jacente. Dans le cas de plusieurs prolongations des échéances disponibles, entrer la durée de l'option ayant la période de prolongation la plus courte pour l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL21	Nature de l'option de prolongation	Seuils de référence concernés pour la possibilité de déclencher/d'exercer l'option de prolongation visée au champ CREL20: Ratio de couverture minimal des intérêts (MICR) Ratio de couverture des charges d'emprunt (MDSC) Ratio prêt-valeur maximal (MLTV) Conditions multiples (MLTC) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL22	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CREL23	Encours actuel du capital	Encours du capital de l'exposition sous-jacente titrisée. Ce montant inclut tous les montants garantis par l'hypothèque et sera assimilé au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital pour la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités. L'encours actuel inclut les impayés sur le capital. Toutefois, le montant de l'épargne doit être déduit en cas de sous-participation (à savoir, encours de l'exposition sous-jacente = exposition sous-jacente +/- sous-participation; +/- 0 s'il n'y a pas de sous-participation). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL24	Encours initial du capital	Encours initial de l'exposition sous-jacente (commissions incluses). Il s'agit de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL25	Encours initial du principal à la date de titrisation	Encours initial du capital de l'exposition sous-jacente titrisée à la date de titrisation tel que désigné dans la circulaire d'offre. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CREL26	Solde non tiré de la facilité engagée pour l'exposition sous-jacente	Facilité totale restante sur l'exposition sous-jacente globale/solde non prélevé à la fin de la période. Le montant de la facilité sur l'exposition sous-jacente globale à la date de fin de l'échéance des intérêts que le débiteur peut encore prélever. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CREL27	Total des autres montants restant à percevoir	Encours des montants cumulés dus sur le prêt (par exemple prime d'assurance, loyers fonciers, dépenses d'investissement) qui ont été payés par la SSPE/l'organe de gestion. Montant cumulé de toutes les mesures de sauvegarde du bien et autres sommes qui ont été avancées par l'organe de gestion ou la SSPE et qui n'ont pas encore été remboursées par le débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL28	Prix d'achat	Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.	NON	OUI
CREL29	Date d'utilisation la plus récente	Date de l'utilisation la plus récente de/du prélèvement le plus récent sur la facilité de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL30	Finalité	But de l'exposition sous-jacente. En cas de buts multiples, indiquer l'option qui décrit le mieux l'accord: Acquisition pour investissement (ACQI) Acquisition pour liquidation (ACQL) Refinancement (RFIN) Construction (CNST) Rénovation (RDVL) Autre (OTHR)	OUI	NON
CREL31	Structure	Structure de l'exposition sous-jacente: Prêt global – non divisé en éléments d'endettement/titres subordonnés (LOAN) Exposition sous-jacente hypothécaire avec participation et dette pari passu en dehors du véhicule d'émission (PMLP)	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Exposition sous-jacente hypothécaire avec participation et dette subordonnée en dehors du véhicule d'émission (PMLS)</p> <p>Prêt A; dans le cadre d'une structure de participation A/B (AABP)</p> <p>Prêt B; dans le cadre d'une structure de participation A/B (BABP)</p> <p>Prêt A; dans le cadre d'une structure de participation A/B/C (AABC)</p> <p>Prêt B; dans le cadre d'une structure de participation A/B/C (BABC)</p> <p>Prêt C; dans le cadre d'une structure de participation A/B/C (CABC)</p> <p>Financement structurel mezzanine (MZZD)</p> <p>Dette subordonnée et documentation du prêt séparée en dehors du véhicule d'émission (SOBD)</p> <p>Autre (OTHR)</p>		
CREL32	Cascade A-B - Versements d'intérêts prévus dans l'échéancier en phase de pré-exécution	<p>Cascade des paiements des intérêts prévue dans l'échéancier en phase d'exécution:</p> <p>Séquentiel (SQNL)</p> <p>Prêt B avec privilège de premier rang (BLLF)</p> <p>Prorata (PRAT)</p> <p>Prorata modifié (MPRT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL33	Cascade A-B - Remboursements du principal prévus dans l'échéancier en phase de pré-exécution	<p>Cascade des remboursements du principal prévus dans l'échéancier en phase d'exécution:</p> <p>Séquentiel (SQNL)</p> <p>Prêt B avec privilège de premier rang (BLLF)</p> <p>Prorata (PRAT)</p> <p>Prorata modifié (MPRT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL34	Remboursements de principal alloués au prêt de premier rang	Insérer le pourcentage de tous les remboursements périodiques du principal prévus dans l'échéancier qui sont destinés au prêt de premier rang (par exemple, prêt A) en cas de prêts multiples dans l'accord de prêt (par exemple, si le champ CREL31 est complété par les valeurs PMLS, AABP, BABP, AABC, BABC, ou CABC).	NON	OUI
CREL35	Type de cascade	<p>Type de cascade régissant l'accord de prêt global:</p> <p>Intérêts A, principal B, intérêts B, principal B (IPIP)</p> <p>Intérêts A, intérêts B, principal A, principal B (IIPP)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL36	Prix d'achat de l'exposition sous-jacente en cas de défaut	Si le détenteur du prêt subordonné (par exemple, détenteur du prêt B) peut acheter le prêt de premier rang en cas de défaut, entrer le prix d'achat conformément à l'accord applicable avec le coprêteur/entre créanciers.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL37	Possibilité de paiements à des fins de rétablissement?	Le détenteur du prêt subordonné (par exemple, détenteur du prêt B) peut-il effectuer des paiements à des fins de rétablissement à la place du débiteur de l'hypothèque? Sélectionner une réponse dans la liste suivante: Aucune possibilité d'effectuer des paiements à des fins de rétablissement (NCP) Possibilité d'effectuer des paiements à des fins de rétablissement jusqu'à une certaine limite fixe tout au long de la durée de vie de l'exposition sous-jacente (FNLP) Possibilité d'effectuer des paiements à des fins de rétablissement sans limite tout au long de la durée de vie de l'exposition sous-jacente (NLCP) Autre (OTHR)	OUI	NON
CREL38	Restrictions concernant la vente du prêt subordonné?	Y a-t-il des restrictions pesant sur la capacité du détenteur du prêt subordonné (par exemple, détenteur du prêt B) à vendre le prêt à un tiers?	NON	OUI
CREL39	Le détenteur du prêt subordonné est-il affilié au débiteur?	Un détenteur de prêt subordonné (par exemple, le détenteur du prêt B) bénéficiant de tous ses droits est-il affilié (c'est-à-dire, membre du même groupe financier) au débiteur de l'hypothèque commerciale?	NON	OUI
CREL40	Contrôle exercé par le détenteur du prêt subordonné sur le processus de rééchelonnement	Le détenteur du prêt subordonné (par exemple, détenteur du prêt B) peut-il exercer un contrôle sur la décision et le processus relatifs à la réalisation et à la vente de la sûreté du prêt?	NON	OUI
CREL41	Y a-t-il défaut sur l'exposition sous-jacente en cas de non-paiement sur les créances prioritaires?	Y a-t-il défaut sur l'exposition sous-jacente en cas de non-paiement sur les créances prioritaires?	NON	OUI
CREL42	Y a-t-il défaut sur le bien en cas de non-paiement sur les expositions sous-jacentes de même rang?	Y a-t-il défaut sur le bien en cas de non-paiement sur les expositions sous-jacentes de même rang?	NON	OUI
CREL43	Consentement du porteur de titres	Le consentement du porteur de titres est-il nécessaire pour une restructuration? «Restructuration» inclut la modification des modalités de versement de l'exposition sous-jacente titrisée (y compris du taux d'intérêt, des commissions, de l'échéance, du calendrier de remboursement et/ou les autres mesures généralement admises concernant les modalités de paiement).	OUI	NON
CREL44	Réunion prévue des porteurs de titres	Quelle est la prochaine date de réunion des porteurs de titres?	NON	OUI
CREL45	Syndication	L'exposition sous-jacente est-elle syndiquée?	OUI	NON

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL46	Participation de la SSPE	Méthode utilisée par la SSPE pour acquérir la propriété de l'exposition sous-jacente syndiquée: Cession (ASGN) Novation (NOVA) Cession en équité (EQTB) Participation financée (intérêt pari passu) (PARI) Participation de rang inférieur (JUNP) Cession en droit (LGAS) Cession notifiée (NOTA) Sous-participation (SUBP) Participation au risque (RSKP) Événement de vente (SALE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL47	Conséquence en cas de rupture de convention	Conséquence de la rupture des clauses financières: Événement de défaut (EDFT) Amortissement supplémentaire (AAMR) Réserve d'excédent de trésorerie (CTRS) Résiliation du contrat de gestion immobilière (TPRM) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL48	Pénalités pour non présentation des informations financières	Le débiteur fait-il l'objet de sanctions pécuniaires pour n'avoir pas présenté les informations financières requises (compte d'exploitation, échéancier, etc.) comme définies par la documentation de l'exposition sous-jacente?	OUI	NON
CREL49	Recours	Y a-t-il recours (complet ou limité) aux actifs du débiteur au-delà du produit réalisé d'une sûreté pour cette exposition sous-jacente?	OUI	OUI
CREL50	Recours – Tiers	Y a-t-il recours (complet ou limité) à un tiers (par exemple, un garant) en cas de manquement du débiteur à une obligation en vertu du contrat relatif à l'exposition sous-jacente?	OUI	OUI
CREL51	Norme de recouvrement	L'organe de gestion de cette exposition sous-jacente titrisée gère-t-il également l'exposition sous-jacente globale ou seulement une/plusieurs composante(s) de l'exposition sous-jacente globale (par exemple, composante A ou B; ou l'une des composantes pari passu)?	NON	NON
CREL52	Total des comptes bloqués	Solde total des comptes de réserve légaux à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL53	Encaissement des fonds de garantie bloqués	Entrer «O» s'il y a des versements placés dans des comptes de réserve à seule fin de couvrir les baux fonciers, les assurances ou les impôts (et non pas l'entretien, les améliorations, les dépenses d'investissement) comme exigé par le contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CREL54	Encaissement d'autres réserves	Y a-t-il des montants placés sur des comptes de réserve autres que pour les taxes sur les baux à construction ou les assurances comme le stipule le contrat relatif à l'exposition sous-jacente pour les améliorations effectuées par le locataire, des commissions de crédit-bail et éléments similaires concernant le bien ou dans le but d'apporter une garantie supplémentaire à cette exposition sous-jacente?	NON	NON
CREL55	Événement déclencheur de la constitution de garantie	Type d'événements déclencheurs de la constitution de montants de réserve: Aucun événement déclencheur (NONE) Ratio prêt/valeur (LVTX) Ratio de couverture des intérêts (ICVR) Ratio de couverture des charges d'emprunt (DSCT) Recettes nettes d'exploitation (NOIT) Autre (OTHR)	OUI	NON
CREL56	Montants/réserves de garantie cibles	Montants/réserves de garantie cibles. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL57	Conditions de mainlevée du compte de garantie	Conditions de mainlevée du compte de garantie. En cas de conditions multiples, chaque condition doit être fournie conformément au schéma XML.	NON	OUI
CREL58	Conditions de prélèvement sur la réserve de trésorerie	Situation dans laquelle la réserve de trésorerie peut être utilisée: Rupture des clauses financières (FICB) Événement déclencheur (TREV) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL59	Devise du compte de garantie	Libellé de la devise des fonds de garantie.	NON	OUI
CREL60	Monnaie des versements de garantie	Devises des versements de garantie. Champs CREL52 et CREL56.	NON	OUI
CREL61	Solde total des réserves	Solde total des comptes de réserve au niveau de l'exposition sous-jacente à la date de versement de l'exposition sous-jacente. Il inclut l'entretien, les réparations et les frais liés à l'environnement, etc. (hors réserves pour assurance et impôts). Il inclut les charges locales dans les réserves. Doit être complété, si le champ CREL54 («Encaissement d'autres réserves») est «O» (oui). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL62	Devise des réserves	Libellé de la devise des comptes de réserve.	NON	OUI
CREL63	Constitution du fonds de garantie consécutive à un événement déclencheur	Entrer «O» s'il s'est produit un événement qui a provoqué la constitution de montants de réserve. Entrer «N» si les fonds de garantie sont constitués pour répondre aux conditions normales du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CREL64	Montants ajoutés aux fonds de garantie pendant la période courante	Montants ayant été ajoutés à des fonds de garantie ou des réserves entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de cette communication de données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL65	Revenus	Total des revenus provenant de toutes les sources pour la période couverte par le compte d'exploitation financier le plus récent (c'est-à-dire depuis le début de l'année ou les 12 derniers mois) pour tous les biens. Peut être normalisé si le contrat de recouvrement applicable l'exige. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CREL66	Charges d'exploitation à la date de titrisation	Total des charges d'exploitation souscrites pour tous les biens comme décrit dans la circulaire d'offre. Elles peuvent inclure les impôts fonciers, l'assurance, l'administration, les services collectifs, l'entretien et les réparations et les coûts directs du bien pour le propriétaire; les dépenses d'investissement et les commissions de location sont exclues. En cas de biens multiples, faire la somme des charges d'exploitation des biens sous-jacents. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL67	Dépenses d'investissement à la date de titrisation	Dépenses d'investissement anticipées tout au long de la vie de l'exposition sous-jacente à la date de titrisation (par opposition aux dépenses de réparation et d'entretien), si indiquées dans la circulaire d'offre. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL68	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise utilisée dans les informations financières des champs CREL65 et CREL66.	OUI	NON
CREL69	Manquement du débiteur à son obligation d'information	Le débiteur manque-t-il à son obligation de transmettre des rapports à l'organe de gestion ou au prêteur de l'exposition sous-jacente? O = oui ou N = Non.	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL70	Méthode de calcul du ratio de couverture des charges d'emprunt	<p>Définir le mode de calcul du taux de couverture des charges d'emprunt requis par la convention, la méthode de calcul induite. Si la méthode de calcul diffère entre le prêt global et le prêt A, entrer la méthode utilisée pour le prêt A.</p> <p>Période actuelle (CRRP)</p> <p>Projection – calcul à six mois (PRSF)</p> <p>Projection – calcul à douze mois (PRTF)</p> <p>Combo 6 – période actuelle et calcul à six mois (CMSF)</p> <p>Combo 12 – période actuelle et calcul à six mois (CMTF)</p> <p>Historique – calcul à six mois (HISF)</p> <p>Historique – calcul à douze mois (HITF)</p> <p>Modifié – inclut une injection de réserve ou un calcul du pourcentage de probabilité de revenu locatif (MODI)</p> <p>Période multiple – calcul pour plusieurs périodes consécutives (MLTP)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CREL71	Indicateur du ratio de couverture des charges d'emprunt à la date de titrisation	<p>Mode de calcul ou d'application du ratio de couverture des charges d'emprunt lorsqu'une exposition sous-jacente concerne plusieurs biens:</p> <p>Partiel – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion laisse le champ vide (PRTL)</p> <p>Moyen – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion n'alloue de charges d'emprunt qu'aux biens pour lesquels il a reçu des informations financières (AVER)</p> <p>Complet – collecte de tous les états financiers pour tous les biens (FULL)</p> <p>Pire scénario – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion alloue 100 % des charges d'emprunt aux biens pour lesquels il a reçu des informations financières (WCAS)</p> <p>Non collecté – aucune information financière reçue (NCOT)</p> <p>Consolidé – tous les biens sont déclarés dans des données financières agrégées par le débiteur (COND)</p> <p>Prêt global fondé sur des contrats de prêt (WLAG)</p> <p>Prêt global fondé sur une autre méthode (WLOT)</p> <p>Billet garanti par un acte de fiducie ou de trust fondé sur un contrat de prêt (TNAG)</p> <p>Billet garanti par un acte de fiducie ou de trust fondé sur une autre méthode (TNOT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL72	Indicateur le plus récent du ratio de couverture des charges d'emprunt	<p>Mode de calcul ou d'application du ratio de couverture des charges d'emprunt lorsqu'une exposition sous-jacente concerne plusieurs biens:</p> <p>Partiel – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion laisse le champ vide (PRTL)</p> <p>Moyen – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion n'alloue de charges d'emprunt qu'aux biens pour lesquels il a reçu des informations financières (AVER)</p> <p>Complet – collecte de tous les états financiers pour tous les biens (FULL)</p> <p>Pire scénario – toutes les données financières des biens n'ont pas été reçues, l'organe de gestion alloue 100 % des charges d'emprunt aux biens pour lesquels il a reçu des informations financières (WCAS)</p> <p>Non collecté – aucune information financière reçue (NCOT)</p> <p>Consolidé – tous les biens sont déclarés dans des données financières agrégées par le débiteur (COND)</p> <p>Prêt global fondé sur des contrats de prêt (WLAG)</p> <p>Prêt global fondé sur une autre méthode (WLOT)</p> <p>Billet garanti par un acte de fiducie ou de trust fondé sur un contrat de prêt (TNAG)</p> <p>Billet garanti par un acte de fiducie ou de trust fondé sur une autre méthode (TNOT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL73	Ratio de couverture des charges d'emprunt à la date de titrisation	Calcul du ratio de couverture des charges d'emprunt pour l'exposition sous-jacente titrisée à la date de titrisation, sur la base de la documentation de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CREL74	Ratio actuel de couverture des charges d'emprunt	Calcul du ratio actuel de couverture des charges d'emprunt pour l'exposition sous-jacente titrisée à la date de titrisation, sur la base de la documentation de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CREL75	Ratio initial prêt/valeur	Ratio prêt/valeur (LTV) pour l'intégralité de l'accord de prêt (c'est-à-dire, ne reflétant pas uniquement le montant titrisé du prêt) à la date de titrisation.	OUI	NON
CREL76	Ratio actuel prêt/valeur	Ratio actuel prêt/valeur (LTV) pour l'intégralité de l'accord de prêt (c'est-à-dire, ne reflétant pas uniquement le montant titrisé du prêt).	OUI	NON
CREL77	Ratio de couverture des intérêts à la date de titrisation	Calcul du ratio de couverture des intérêts pour l'exposition sous-jacente titrisée à la date de titrisation.	OUI	NON
CREL78	Ratio actuel de couverture des intérêts	Calcul du ratio actuel de couverture des intérêts pour l'exposition sous-jacente titrisée.	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL79	Méthode de calcul du ratio de couverture des intérêts	Définir le mode de calcul du ratio de couverture des intérêts requis par la convention au niveau de l'exposition sous-jacente titrisée (ou au niveau de l'exposition sous-jacente globale en l'absence d'indication concernant des accords d'exposition sous-jacente spécifiques dans l'accord de prêt global), la méthode de calcul induite: Période actuelle (CRRP) Projection – calcul à six mois (PRSF) Projection – calcul à douze mois (PRTF) Combo 6 – période actuelle et calcul à six mois (CMSF) Combo 12 – période actuelle et calcul à six mois (CMTF) Historique – calcul à six mois (HISF) Historique – calcul à douze mois (HITF) Modifié – inclut une injection de réserve ou un calcul du pourcentage de probabilité de revenu locatif (MODI) Période multiple – calcul pour plusieurs périodes consécutives (MLTP) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL80	Nombre de biens à la date de titrisation	Nombre de biens utilisés comme garantie pour l'exposition sous-jacente à la date de titrisation.	NON	OUI
CREL81	Nombre de biens à la date d'arrêt des données	Nombre de biens utilisés comme garantie pour l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CREL82	Biens constituant la sûreté de l'exposition sous-jacente	Entrer les identifiants uniques (CREC4) des biens qui servent de garantie pour l'exposition sous-jacente à la date d'arrêt des données. En cas de biens multiples, entrer tous les identifiants comme indiqué dans le schéma XML.	NON	NON
CREL83	Valorisation du portefeuille de biens à la date de titrisation	Valorisation des biens en garantie de l'exposition sous-jacente à la date de titrisation comme décrit dans la circulaire d'offre. En cas de biens multiples, indiquer la somme de la valeur des biens. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL84	Monnaie dans laquelle est exprimée la valeur du portefeuille de biens à la date de titrisation	Devise de la valorisation dans le champ CREL83.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL85	Statut des biens	Statut des biens immobiliers. En cas de situations multiples figurant dans la liste ci-dessous, sélectionner la situation qui représente le mieux l'ensemble des biens. Mandat permanent (LPOA) Administration judiciaire (RCVR) Saisie (FCLS) Propriété foncière (REOW) Défaillance (DFSD) Libération partielle (PRLS) Libération (RLSD) Identique à la date de titrisation (SCDT) En recouvrement spécial (SSRV) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL86	Date d'établissement de la valorisation à la date de titrisation	Date à laquelle la valorisation des biens indiquée dans la circulaire d'offre a été effectuée. S'il y a plusieurs biens et plusieurs dates, indiquer la date la plus récente.	NON	OUI
CREL87	Type d'amortissement	Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts: Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX) Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX) Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE) In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT) Autre (OTHR)	OUI	NON
CREL88	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
CREL89	Période de grâce autorisée	Nombre de jours passés au-delà de l'échéance pendant lesquels le prêteur ne considérera pas le défaut de paiement comme un événement de défaut. Cette période concerne les défauts de paiement pour des raisons non techniques (à savoir, les défauts de paiement ne résultant pas de défaillances du système, par exemple).	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL90	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL91	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL92	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
CREL93	Description des conditions de remboursement anticipé	Doit refléter les informations de la circulaire d'offre. Par exemple, si les conditions de remboursement anticipé prévoient une pénalité de 1 % l'année un, 0,5 % l'année deux et 0,25 % l'année trois du prêt, ces indications peuvent apparaître dans la circulaire d'offre sous la forme: 1 %(12), 0,5 %(24), 0,25 %(36).	OUI	OUI
CREL94	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CREL95	Date de fin de l'indemnité actuarielle	Date à partir de laquelle il peut y avoir remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans indemnité actuarielle.	NON	OUI
CREL96	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le non-paiement d'intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL97	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL98	Encaissements de principal non prévus à l'échéancier	<p>Versements hors échéancier sur le capital, reçus pendant la période de collecte la plus récente. Autres versements reçus pendant la période d'échéance des intérêts, utilisés pour rembourser l'exposition sous-jacente. Il peut s'agir de produits de la vente, de remboursements anticipés volontaires, ou de montants provenant d'une liquidation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL99	Date de liquidation/ remboursement anticipé	Date la plus récente à laquelle est reçu un versement au capital non prévu à l'échéancier ou sont reçus des produits de la liquidation	NON	OUI
CREL100	Code de liquidation/ remboursement anticipé	<p>Code affecté à tout versement non prévu au capital ou aux produits de la liquidation reçus durant la période de collecte:</p> <p>Liquidation partielle (réduction de régime) (PTLQ)</p> <p>Remboursement avant échéance (PTPY)</p> <p>Liquidation ou cession (LQDP)</p> <p>Rachat ou substitution (RPSB)</p> <p>Remboursement intégral à l'échéance (FLPY)</p> <p>Remboursement réduit (DPOX)</p> <p>Remboursement avec pénalité (PYPN)</p> <p>Remboursement avec indemnité actuarielle (YLMT)</p> <p>Réduction avec pénalité (CPTL)</p> <p>Réduction avec indemnité actuarielle (YLMT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL101	Trop-perçu/moins-perçu sur les intérêts lié à un remboursement anticipé	<p>Moins-perçu ou trop-perçu d'intérêts par rapport aux intérêts prévus à l'échéancier, non lié à un défaut de paiement sur l'exposition sous-jacente. Provient d'un remboursement anticipé reçu à une date autre que la date d'échéance prévue: Moins-perçu – différence par laquelle le montant des intérêts versés est inférieur aux intérêts prévus à l'échéancier qui étaient dus à la date de versement de l'exposition sous-jacente (s'applique uniquement s'il y a un moins-perçu après que le débiteur a payé des frais de résiliation). Trop-perçu – intérêts encaissés au-delà des intérêts courus dus pour la période de cumul des intérêts de l'exposition sous-jacente. Un nombre négatif représente un moins-perçu et un trop-perçu est représenté par un nombre positif.</p> <p>Renvoie à l'intégralité de l'accord de prêt (c'est-à-dire, ne reflète pas uniquement le montant de l'exposition sous-jacente titrisée).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL102	Date de paiement	Date la plus récente à laquelle le capital et les intérêts sont versés à la SSPE à la date d'arrêté des données, normalement la date de versement des intérêts de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL103	Prochaine date d'ajustement des versements	Pour les expositions sous-jacentes à taux variable, la prochaine date à laquelle le montant du capital et/ou des intérêts doit être modifié. Pour les expositions sous-jacentes à taux fixe, entrer la prochaine date de versement.	NON	OUI
CREL104	Date du prochain versement	Date du prochain versement de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL105	Prochain paiement dû	Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL106	Taux d'intérêt initial	Taux d'intérêt global à la date d'initiation de l'exposition sous-jacente titrisée.	OUI	NON
CREL107	Taux d'intérêt à la date de titrisation	Taux d'intérêt global (par exemple, EURIBOR + marge) utilisé pour calculer les intérêts dus sur l'exposition sous-jacente titrisée pour la première date de versement des intérêts après la date de titrisation.	OUI	NON
CREL108	Première date d'ajustement des versements	Pour les expositions sous-jacentes à taux variable, la première date à laquelle le montant du capital et/ou des intérêts doit être modifié. Pour les expositions sous-jacentes à taux fixe, entrer la première date à laquelle le montant du capital ou des intérêts est dû (et non la première date après la titrisation à laquelle il est susceptible d'être modifié).	OUI	OUI
CREL109	Type de taux d'intérêt	Type de taux d'intérêt: Exposition sous-jacente à taux variable (permanent) (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable liée à un indice qui passera à un autre indice dans l'avenir (FINX) Exposition sous-jacente à taux fixe (permanent) (FXRL) Taux fixe avec de futures révisions périodiques (FXPR) Exposition sous-jacente à taux fixe avec un futur passage obligatoire à un taux variable (FLCF)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plafond (CAPP) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher et une valeur plafond (FLIF) Taux d'actualisation (DISC) Option de modification (SWIC) Échange entre débiteurs (OBLS) Modulaire (MODE) Autre (OTHR)		
CREL110	Taux d'intérêt actuel	Taux brut annuel utilisé pour calculer les intérêts sur la période courante de l'échéancier de l'exposition sous-jacente titrisée. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI
CREL111	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIAswaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
CREL112	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL113	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI
CREL114	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL115	Valeur actuelle de l'indice	Indice utilisé pour déterminer le taux d'intérêt actuel sur l'exposition sous-jacente titrisée. Taux d'intérêt (avant marge) utilisé pour calculer les intérêts payés à la date de versement de l'exposition sous-jacente titrisée dans le champ CREL102.	NON	OUI
CREL116	Date de détermination de l'indice	Si le contrat relatif à l'exposition sous-jacente prévoit des dates spécifiques pour fixer le taux, entrer la prochaine date de détermination de l'indice.	NON	OUI
CREL117	Incrément d'arrondi	Incrément exprimé en pourcentage pour arrondir un taux afin de déterminer le taux d'intérêt conformément au contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL118	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL119	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL120	Taux actuel des intérêts pour défaut	Taux d'intérêt utilisé pour calculer les intérêts pour défaut à la date de versement de l'exposition sous-jacente titrisée dans le champ CREL102.	NON	OUI
CREL121	Cumul des intérêts autorisé	Les documents décrivant les conditions de l'exposition sous-jacente autorisent-ils le cumul et la capitalisation des intérêts?	OUI	NON
CREL122	Convention de calcul des jours	Convention sur le décompte des «jours» servant à calculer les intérêts: 30/360 (A011) Réel/365 (A005) Réel/360 (A004) Réel/réel ICMA (A006) Réel/réel ISDA (A008) Réel/réel AFB (A010) Réel/366 (A009) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL123	Total du principal et des intérêts dus conformément à l'échéancier	Principal et intérêts dus conformément à l'échéancier à la date la plus récente de versement de l'exposition sous-jacente titrisée, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CREL124	Total du principal et des intérêts versés conformément à l'échéancier	Principal et intérêts versés conformément à l'échéancier à la date la plus récente de versement de l'exposition sous-jacente titrisée, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CREL125	Amortissement négatif	Amortissement négatif/intérêt différé/intérêt capitalisé sans pénalité. Un amortissement négatif survient lorsque les intérêts courus pendant une période de versement sont supérieurs au versement prévu et le montant excédentaire est ajouté à l'encours de l'exposition sous-jacente. Renvoie à l'intégralité de l'accord de prêt (c'est-à-dire, ne reflète pas uniquement le montant de l'exposition sous-jacente titrisée). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL126	Intérêts différés	Intérêts différés sur le prêt global (c'est-à-dire, y compris le prêt titrisé et tout autre prêt relevant de l'accord de prêt avec le débiteur). Les intérêts différés représentent la différence entre les intérêts qu'un débiteur paie effectivement en moins sur un prêt hypothécaire et la valeur des intérêts capitalisés sur l'encours du capital. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CREL127	Encours total des moins-perçus enregistrés sur le principal et les intérêts	Montants cumulés sur le capital et les intérêts dus sur l'intégralité de l'accord de prêt (c'est-à-dire, pas uniquement l'exposition sous-jacente titrisée) à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL128	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI
CREL129	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CREL130	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêt des données.	NON	NON
CREL131	Raison du défaut ou de la saisie	Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée: En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX) En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX) En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL132	Montant du défaut	Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements, y compris les commissions capitalisées/pénalités/etc. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL133	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
CREL134	Arriérés d'intérêt	Y a-t-il des arriérés sur les intérêts à recevoir sur l'exposition sous-jacente?	NON	NON
CREL135	Intérêts réels versés pour défaut de paiement	Intérêts réels versés pour défaut de paiement entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de la présente communication de données. Montant total des intérêts pour défaut versés par le débiteur au cours de la période d'échéance des intérêts ou à la date de versement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL136	Situation du compte	Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée: Performante (PERF) Restructurée – aucun arriéré (RNAR) Restructurée – arriérés (RARR) En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT) Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT) En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR) En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB) Arriérés (ARRE) Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR) Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF) Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS)</p> <p>Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)</p> <p>Remboursée (RDMD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaires de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
CREL137	Pertes allouées	<p>Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL138	Produits nets reçus de la liquidation	<p>Produits nets reçus de la liquidation utilisés pour déterminer la perte de la SSPE conformément aux documents de la titrisation. Le montant des produits nets de la vente reçus déterminera s'il y a eu une perte ou un manque à gagner sur l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL139	Frais de liquidation	<p>Frais associés à la liquidation à déduire des autres actifs de l'émetteur pour déterminer la perte conformément aux documents de la titrisation. Montant de tous frais de liquidation payés sur le produit net de la vente pour déterminer s'il y a eu une perte.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL140	Calendrier attendu des recouvrements	Calendrier attendu des recouvrements par l'organe de gestion de l'exposition sous-jacente, en mois.	NON	OUI
CREL141	Recouvrements cumulés	<p>Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL142	Date de début de la phase d'exécution	Date à laquelle la saisie ou la procédure d'administration ou une procédure d'exécution alternative a été engagée à l'encontre du débiteur ou acceptée par lui.	NON	OUI
CREL143	Code de la stratégie de restructuration	Stratégie de restructuration: Modification (MODI) Exécution (ENFR) Administration judiciaire (RCVR) Insolvabilité (NSOL) Prolongation (XTSN) Vente du prêt (LLES) Remboursement réduit (DPFF) Bien en possession (PPOS) Restructuré (RSLV) Dans l'attente du retour à l'organe de gestion (PRTS) Remise du titre de propriété au lieu de la saisie (DLFR) Remboursement intégral (FPOF) Déclarations et garanties (REWR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL144	Modification	Type de modification: Prolongation de la date d'échéance (MEXT) Modification de l'amortissement (AMMC) Réduction de la valeur du principal (PWOFF) Réduction temporaire du taux (TMRR) Capitalisation des intérêts (CINT) Capitalisation des coûts avancés (par exemple, assurance, loyer) (CPCA) Combinaison (COMB) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL145	Statut en matière de recouvrement spécial	À la date de versement de l'exposition sous-jacente, l'exposition sous-jacente fait-elle l'objet d'un recouvrement spécial (special servicing)?	NON	NON
CREL146	Date la plus récente de cession à un organe de gestion spécial	Date à laquelle une exposition sous-jacente a été cédée à un organe de gestion spécial à la suite d'un événement de transfert de recouvrement. Remarque: si l'exposition sous-jacente a déjà fait l'objet de plusieurs transferts, indiquer la date du dernier transfert.	NON	OUI
CREL147	Date de dernier retour à l'organe de gestion principal	Date à laquelle une exposition sous-jacente devient une «exposition sous-jacente hypothécaire corrigée», soit la date à laquelle l'organe de gestion spécial a rendu l'exposition sous-jacente à l'organe de gestion principal. Remarque: si l'exposition sous-jacente a déjà fait l'objet de plusieurs transferts, indiquer la date de la dernière restitution à l'organe de gestion principal.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL148	Détermination de l'impossibilité de recouvrer les fonds	Indicateur (Oui/Non): l'organe de gestion ou l'organe de gestion spécial a-t-il déterminé qu'il y aura un moins-perçu sur le recouvrement des avances qu'il a faites et l'encours de l'exposition sous-jacente et autres montants restants dus à partir des produits de la vente ou de la liquidation du bien ou de l'exposition sous-jacente?	OUI	OUI
CREL149	Élément déclencheur/violation de la convention	Type d'élément déclencheur/violation de la convention: Ratio de couverture des intérêts (ICRX) Ratio de couverture des charges d'emprunt (DSCR) Ratio prêt-valeur (LLTV) Ratio de couverture des intérêts ou ratio de couverture des charges d'emprunt (ICDS) Ratio de couverture des intérêts ou ratio de couverture des charges d'emprunt ou ratio prêt-valeur (ICDL) Violation au niveau du bien (PROP) Violation au niveau du débiteur (OBLG) Violation au niveau du locataire ou de l'inoccupation (TENT) Autre (OTHR)	NON	OUI
CREL150	Date de violation	Date à laquelle une violation des conditions de l'exposition sous-jacente est survenue. En cas de multiples occurrences, date de la violation la plus récente.	OUI	OUI
CREL151	Date à laquelle la violation a cessé	Date à laquelle une violation déclarée dans le champ CREL150 a cessé. En cas de violations multiples, date à laquelle la dernière violation a cessé.	NON	OUI
CREL152	Code de la liste de surveillance des organes de gestion	Si l'exposition sous-jacente a été entrée dans la liste de surveillance des organes de gestion, entrer le code correspondant le plus approprié figurant dans le tableau 2 de l'annexe 1 du présent règlement. Si plusieurs critères sont applicables, indiquer le code le plus négatif.	NON	OUI
CREL153	Date d'inscription sur la liste de surveillance des organes de gestion	Date à laquelle il a été décidé de placer l'exposition sous-jacente sur la liste de surveillance. Si l'exposition sous-jacente était sortie de la liste antérieurement et qu'elle y réapparaît maintenant, utiliser la nouvelle date d'entrée.	NON	OUI
CREL154	Fournisseur du swap de taux d'intérêt	S'il y a un swap de taux d'intérêt sur l'exposition sous-jacente, indiquer la dénomination sociale complète du fournisseur du swap de taux d'intérêt. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CREL155	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de taux d'intérêt	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur du swap de taux d'intérêt pour l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL156	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt au niveau de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL157	Notionnel du swap de taux d'intérêt	Montant notionnel du swap de taux d'intérêt au niveau de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL158	Fournisseur du swap de devises	S'il y a un swap de devises sur l'exposition sous-jacente, indiquer la dénomination sociale complète du fournisseur du swap de devises. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CREL159	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de devises	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur du swap de devises pour l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL160	Date d'échéance du swap de devises	Date d'échéance du swap de devises au niveau de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL161	Notionnel du swap de devises	Montant notionnel du swap de devises au niveau de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREL162	Taux de change pour swap de devises	Taux de change ayant été fixé pour un swap de devises au niveau de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL163	Fournisseur d'un autre type de swap	Indiquer la dénomination sociale complète du fournisseur du swap pour l'exposition sous-jacente, lequel n'est ni un swap de taux d'intérêt, ni un swap de devises. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CREL164	Identifiant d'entité juridique du fournisseur d'un autre type de swap	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur de l'autre swap pour l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL165	Frais de résiliation du swap dus par le débiteur	Dans quelle mesure le débiteur a l'obligation de payer des frais de résiliation au fournisseur du swap pour l'exposition sous-jacente? En cas de swaps multiples, entrer la valeur la plus appropriée. Indemnisation totale de la part du débiteur (TOTL) Indemnisation partielle de la part du débiteur (PINO) Aucune indemnisation de la part du débiteur (TOTL)	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL166	Événement à l'origine de l'annulation totale ou partielle du swap durant la période en cours	<p>Si le swap pour l'exposition sous-jacente a été annulé entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de la présente communication de données, préciser la raison. En cas de swaps multiples, entrer la valeur la plus appropriée.</p> <p>Swap annulé en raison de la baisse de notation du fournisseur du swap pour l'exposition sous-jacente (RTDW)</p> <p>Swap annulé en raison d'un défaut de paiement au fournisseur du swap pour l'exposition sous-jacente (PYMD)</p> <p>Swap annulé en raison d'un autre type de défaillance de la contrepartie du swap pour l'exposition sous-jacente (CNTD)</p> <p>Swap annulé en raison du remboursement anticipé complet ou partiel du débiteur (PRPY)</p> <p>Swap annulé en raison d'un autre type de défaillance du débiteur (OBDG)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CREL167	Montant net des versements réguliers effectués par le fournisseur du swap	<p>Montant net du versement effectué par la contrepartie du swap pour l'exposition sous-jacente titrisée à la date de versement de l'exposition sous-jacente, tel que requis par le contrat de swap. Ce montant n'inclut pas les paiements de frais de résiliation ou d'annulation. En cas de swaps multiples, entrer la somme des montants pour tous les swaps.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL168	Frais de résiliation du swap dus au fournisseur du swap sur l'exposition sous-jacente	<p>Montant de tout versement dû par le débiteur à la contrepartie du swap pour avoir mis fin au swap complètement ou partiellement. En cas de swaps multiples, entrer la valeur la plus appropriée.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL169	Moins-perçu sur le paiement des frais de résiliation du swap	<p>Montant de tout moins-perçu, s'il y a lieu, pour couvrir les frais d'annulation du swap à la suite de la résiliation complète ou partielle du swap, payé par le débiteur. En cas de swaps multiples, entrer la somme des montants pour tous les swaps.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CREL170	Frais de résiliation dus par la contrepartie du swap	<p>Montant de tout trop-perçu payé au débiteur par la contrepartie du swap à la résiliation complète ou partielle du swap. En cas de swaps multiples, entrer la valeur la plus appropriée.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREL171	Prochaine date de révision du swap	Prochaine date de révision du swap au niveau de l'exposition sous-jacente. En cas de swaps multiples, entrer la valeur la plus appropriée.	NON	OUI
CREL172	Sponsor	Nom du sponsor de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL173	Identifiant d'entité juridique de la banque chef de file de la syndication	Indiquer l'identifiant d'entité juridique (tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF) de la banque chef de file de la syndication, à savoir l'entité agissant en qualité d'interface entre le débiteur et les prêteurs intervenant dans la syndication de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL174	Identifiant d'entité juridique de l'organe de gestion	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'organe de gestion de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CREL175	Nom de l'organe de gestion	Indiquer la dénomination sociale complète de l'organe de gestion de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CREL176	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
CREL177	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CREL178	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CREL179	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
CREL180	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
CREL181	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
---------------	--------------	--------------------	-------------------	---------------

Informations au niveau de la sûreté

CREC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ CREL1.	NON	NON
CREC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ CREL5. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREC3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREC4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ CREC3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CREC3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CREC5	Type de sûreté	Principal type d'actif (en termes de valeur) garantissant la dette. Dans le cas de garanties adossées à des sûretés physiques ou financières, se baser sur toutes les sûretés sur lesquelles la garantie est adossée. Automobile (CARX) Véhicule industriel (INDV) Camion commercial (CMTR) Véhicule ferroviaire (RALV) Véhicule nautique commercial (NACM) Véhicule nautique de loisir (NALV) Avion (AERO) Machine-outil (MCHT) Équipement industriel (INDE) Équipement de bureau (OFEQ) Équipement informatique (ITEQ) Équipement médical (MDEQ) Équipement lié à l'énergie (ENEQ) Bâtiment commercial (CBLD) Bâtiment résidentiel (RBLD) Bâtiment industriel (IBLD) Autre véhicule (OTHV) Autre équipement (OTHE)	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Autre bien immobilier (OTRE) Autres produits ou stocks (OTGI) Titres (SECU) Garantie (GUAR) Autre actif financier (OTFA) Catégories mixtes correspondant à une sûreté constituée sur tous les actifs du débiteur (MIXD) Autre (OTHR)		
CREC6	Nom du bien	Nom du bien qui sert de garantie pour l'exposition sous-jacente. Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
CREC7	Adresse du bien	Adresse du bien qui sert de garantie pour l'exposition sous-jacente. Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
CREC8	Région géographique – Sûreté	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est située la sûreté physique Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
CREC9	Code postal du bien	Code postal complet du bien principal. Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
CREC10	Privilège	Position de privilège la plus élevée détenue par l'initiateur en ce qui concerne la sûreté.	OUI	OUI
CREC11	Statut du bien	Statut des biens: Mandat permanent (LPOA) Administration judiciaire (RCVR) Saisie (FCLS) Propriété foncière (REOW) Défaisance (DFSD) Libération partielle (PRLS) Libération (RLSD) Identique à la date de titrisation (SCDT) En recouvrement spécial (SSRV) Autre (OTHR) Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREC12	Type de bien	Type de bien: Camping (CRPV) Parking (CARP) Bâtiment hospitalier (HEAL) Bâtiment d'hôtellerie/hôtel (HOTL) Bâtiment industriel (NACE) Terrain uniquement (LAND) Bâtiment de loisir (LEIS) Bien multifamilles (MULF) Bien à usage mixte (MIXD) Bureau (OFFC) Pub (PUBX) Commerce de détail (RETL) Entrepôt individuel (SSTR) Entrepôt (WARE) Divers (VARI) Autre (OTHR) Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
CREC13	Forme du titre de propriété du bien	Forme du titre de propriété. Un bail à construire sur un terrain seulement sur lequel le débiteur possède généralement un bâtiment ou doit construire ce qui est spécifié dans le contrat de location. Ce type de baux correspond habituellement aux baux nets de longue durée; Les droits et obligations du débiteur sont maintenus jusqu'à l'expiration du bail ou sa résiliation en cas de défaut: Bien soumis à bail (LESH) Pleine propriété (FREE) Mixte (MIXD) Autre (OTHR) Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer ND5.	NON	OUI
CREC14	Date de valorisation actuelle	Date de la valorisation la plus récente.	OUI	OUI
CREC15	Montant de la valorisation actuelle	Valorisation la plus récente du bien telle qu'estimée par un expert indépendant externe ou interne; dans le cas où une telle estimation n'est pas disponible, la valeur actuelle du bien peut être estimée à l'aide d'un indice de la valeur des biens immobiliers suffisamment détaillé en ce qui concerne l'emplacement géographique et le type du bien; si un tel indice n'est pas disponible non plus, un indice des prix de l'immobilier suffisamment détaillé en ce qui concerne l'emplacement géographique et le type du bien peut être utilisé après application d'une décote choisie de manière appropriée pour tenir compte de la dépréciation du bien.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Si la sûreté déclarée n'est pas un bien immobilier, entrer sa plus récente valorisation telle qu'estimée par un expert indépendant externe ou interne, ou, si elle n'est pas disponible, par l'initiateur.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>		
CREC16	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	<p>Méthode de calcul la plus récente de la valeur de la sûreté indiquée dans le champ CREC15:</p> <p>Inspection complète, interne et externe (FALL)</p> <p>Inspection complète, uniquement externe (FEXT)</p> <p>Inspection rapide (DRVB)</p> <p>Modèle de valorisation automatisé (AUVM)</p> <p>Indexée (IDX)</p> <p>Par ordinateur (DKTP)</p> <p>Mandataire/agent immobilier (MAEA)</p> <p>Autorité fiscale (TXAT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CREC17	Date de valorisation actuelle	<p>Base de valorisation la plus récente:</p> <p>Marché libre (OPEN)</p> <p>Bien vacant (VCNT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CREC18	Méthode suivie pour la valorisation initiale	<p>Méthode de calcul de la valeur de la sûreté au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Inspection complète, interne et externe (FALL)</p> <p>Inspection complète, uniquement externe (FEXT)</p> <p>Inspection rapide (DRVB)</p> <p>Modèle de valorisation automatisé (AUVM)</p> <p>Indexée (IDX)</p> <p>Par ordinateur (DKTP)</p> <p>Mandataire/agent immobilier (MAEA)</p> <p>Autorité fiscale (TXAT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CREC19	Date de titrisation de la sûreté	<p>Date à laquelle le bien/la sûreté a été donné(e) en garantie de l'exposition sous-jacente. Si le bien/la sûreté a été remplacé(e), entrer la date de substitution. Si le bien/la sûreté faisait partie de la titrisation initiale, ce sera la date de titrisation.</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREC20	Pourcentage de l'exposition sous-jacente alloué à la date de titrisation	Pourcentage de l'exposition sous-jacente couvert par le bien/la sûreté à la date de titrisation lorsqu'il y a plus d'un(e) bien/sûreté en garantie de l'exposition sous-jacente. Ce pourcentage peut être indiqué dans le contrat relatif à l'exposition sous-jacente, ou alloué par valorisation (recettes nettes d'exploitation).	OUI	OUI
CREC21	Pourcentage de l'exposition sous-jacente actuellement alloué	Pourcentage de l'exposition sous-jacente couvert par la sûreté à la date de versement de l'exposition sous-jacente. Lorsqu'il y a plus d'une sûreté en garantie de l'exposition sous-jacente, la somme de tous les pourcentages est égale à 100 %. Ce pourcentage peut être indiqué dans le contrat relatif à l'exposition sous-jacente, ou alloué par valorisation (recettes nettes d'exploitation).	NON	OUI
CREC22	Valorisation à la date de titrisation	Valorisation du bien/de la sûreté en garantie de l'exposition sous-jacente à la date de titrisation comme décrit dans la circulaire d'offre. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREC23	Nom de l'entité chargée de la valorisation à la date de titrisation	Nom de l'organe d'évaluation qui a effectué la valorisation du bien/de la sûreté à la date de titrisation.	NON	OUI
CREC24	Date de préparation de la valorisation à la date de titrisation	Date à laquelle la valorisation des biens indiquée dans la circulaire d'offre a été effectuée.	NON	OUI
CREC25	Année de construction	Année de construction du bien selon le rapport d'évaluation ou la documentation de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CREC26	Dernière année de rénovation	Année où a été réalisée la dernière rénovation majeure/nouvelle construction du bien selon le rapport d'évaluation ou la documentation de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CREC27	Nombre d'unités	Pour le type de bien multifamilles, entrer le nombre d'unités, pour les bâtiments d'hôtellerie/bâtiments hospitaliers, entrer le nombre de lits, pour les campings, les unités, pour une habitation, le nombre de pièces, pour les entrepôts individuels, les unités.	NON	OUI
CREC28	Mètres carrés nets	Surface totale nette susceptible d'être louée en mètres carrés du bien qui sert de garantie pour l'exposition sous-jacente selon le rapport d'évaluation le plus récent.	NON	OUI
CREC29	Surface commerciale	Surface commerciale nette totale (en mètres carrés) louable du bien qui sert de garantie pour l'exposition sous-jacente selon le rapport d'évaluation le plus récent.	NON	OUI
CREC30	Surface résidentielle	Surface habitable nette totale (en mètres carrés) louable du bien qui sert de garantie pour l'exposition sous-jacente selon le rapport d'évaluation le plus récent.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREC31	Surface utile nette contrôlée	Est-ce que l'évaluateur (de la plus récente valorisation) a vérifié la surface utile nette du bien?	OUI	OUI
CREC32	Occupation à la dernière date pertinente	Date du calendrier de location/liste des loyers reçu le plus récemment. Pour les bâtiments d'hôtellerie (hôtels) et les bâtiments hospitaliers, utiliser le taux d'occupation moyen pendant la période couverte par les rapports financiers.	NON	OUI
CREC33	Taux d'occupation économique à la date de titrisation	Pourcentage de la surface à louer faisant l'objet d'un contrat de location signé à la date de titrisation, si indiqué dans la circulaire d'offre (les locataires peuvent ne pas occuper les lieux, mais paient le loyer).	NON	OUI
CREC34	Taux d'occupation physique à la date de titrisation	À la date de titrisation, pourcentage disponible d'espace susceptible d'être loué réellement occupé (c'est-à-dire physiquement occupé par les locataires et non libéré), si indiqué dans la circulaire d'offre. Le calculer à partir du registre des loyers ou de tout autre document indiquant un taux d'occupation cohérent avec les informations financières les plus récentes.	NON	OUI
CREC35	Valeur du bien vacant à la date de titrisation	Valeur du bien vacant à la date de titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREC36	Date des données financières utilisées à la date de titrisation	Date de fin de la période de validité des données financières pour les informations utilisées dans la circulaire d'offre (par exemple depuis le début de l'année, annuelle, trimestrielle ou les 12 derniers mois).	OUI	OUI
CREC37	Recettes nettes d'exploitation à la date de titrisation	Revenus déduction faite des frais d'exploitation à la date de titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CREC38	Date de début de la période couverte par les informations financières les plus récentes	Date de début de la période couverte dans les informations financières utilisées pour le compte d'exploitation financier le plus récent (par exemple mensuel, trimestriel, cumul annuel jusqu'à ce jour, 12 derniers mois).	OUI	OUI
CREC39	Date de fin de la période couverte par les informations financières les plus récentes	Date de fin des informations financières utilisées pour le compte d'exploitation financier le plus récent (par exemple mensuel, trimestriel, cumul annuel jusqu'à ce jour, les 12 derniers mois).	OUI	OUI
CREC40	Revenu le plus récent	Total des recettes pour la période couverte par le compte d'exploitation financier le plus récent (par exemple mensuel, trimestriel, cumul annuel jusqu'à ce jour, les 12 derniers mois), pour le bien. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREC41	Dépenses d'exploitation les plus récentes	Total des dépenses d'exploitation pour la période couverte par le compte d'exploitation financier le plus récent (par exemple mensuel, trimestriel, cumul annuel jusqu'à ce jour, les 12 derniers mois) pour le bien. Elles peuvent inclure les impôts fonciers, l'assurance, l'administration, les services collectifs, l'entretien et les réparations et les coûts directs du bien pour le propriétaire; les dépenses d'investissement et les commissions de location sont exclues. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CREC42	Dépenses d'investissement les plus récentes	Dépenses d'investissement totales (par opposition aux dépenses de réparations et d'entretien) pour la période couverte par le compte d'exploitation financier le plus récent (par exemple mensuel, trimestriel, cumul annuel jusqu'à ce jour, les 12 derniers mois) pour le bien. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CREC43	Loyer foncier	Si le bien est soumis à bail, indiquer le loyer annuel courant payable au bailleur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREC44	Durée moyenne pondérée des baux	Durée des baux en moyenne pondérée (en années), en utilisant comme facteur de pondération la valeur locative résiduelle.	NON	OUI
CREC45	Expiration du contrat de location	Indiquer la date la plus proche à laquelle le contrat de location expire.	NON	OUI
CREC46	Revenu locatif contractuel annuel	Revenu contractuel annuel des loyers calculé à partir du calendrier d'occupation le plus récent du débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CREC47	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 1 à 12 mois	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans un délai de 1 à 12 mois.	OUI	OUI
CREC48	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 13 à 24 mois	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans un délai de 13 à 24 mois.	OUI	OUI
CREC49	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 25 à 36 mois	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans un délai de 25 à 36 mois.	OUI	OUI
CREC50	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 37 à 48 mois	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans un délai de 37 à 48 mois.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CREC51	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 49 mois ou plus	Pourcentage de recettes qui arriveront à expiration dans un délai de 49 mois ou plus.	OUI	OUI

Informations au niveau du locataire

CRET1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ CREL1.	NON	NON
CRET2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ CREL5. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRET3	Identifiant de la sûreté	Identifiant unique de la sûreté. Ce champ doit correspondre au champ CREC4 pour permettre la cartographie.	NON	NON
CRET4	Identifiant du locataire	Identifiant unique du locataire. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRET5	Nom du locataire	Nom du locataire actuel. Si le locataire est une personne physique, ce champ doit être complété par la même entrée que dans le champ CRET4.	OUI	NON
CRET6	Code NACE de l'activité	Code NACE de l'activité du locataire selon le règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾ .	OUI	OUI
CRET7	Date d'expiration du contrat de location	Date d'expiration du contrat de location du locataire actuel.	NON	OUI
CRET8	Loyer demandé	Loyer annuel à payer par le locataire actuel. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRET9	Monnaie du loyer	Libellé de la devise du loyer.	NON	OUI

⁽¹⁾ 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).



ANNEXE IV

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – ENTREPRISES

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
CRPL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) [2020/1224.	NON	NON
CRPL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ CRPL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CRPL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ CRPL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CRPL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
CRPL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CRPL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI
CRPL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL10	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
CRPL11	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
CRPL12	Débiteur en difficulté	<p>Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1 du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial:</p> <p>a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:</p> <p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
CRPL13	Type de client	<p>Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO)</p> <p>Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (ENEO)</p> <p>Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO)</p> <p>Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CRPL14	Code NACE de l'activité	Code NACE de l'activité du débiteur, conformément au règlement (CE) n° 1893/2006.	OUI	OUI
CRPL15	Segment du débiteur selon Bâle III	<p>Segment du débiteur selon Bâle III:</p> <p>Entreprises (CORP)</p> <p>Petites et moyennes entreprises considérées comme des entreprises (SMEX)</p> <p>Commerce de détail (RETL)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL16	Taille de l'entreprise	<p>Classification des entreprises par taille, conformément à l'annexe de la recommandation 2003/361/CE de la Commission:</p> <p>Micro-entreprise (MICE) – entreprise qui occupe moins de 10 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel ou le total du bilan annuel n'excède pas 2 millions d'euros</p> <p>Petite entreprise (SMAE) – entreprise qui occupe moins de 50 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel ou le total du bilan annuel n'excède pas 10 millions d'euros</p> <p>Moyenne entreprise (MEDE) – entreprise qui occupe moins de 250 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel n'excède pas 50 millions d'euros ou dont le total du bilan annuel n'excède pas 43 millions d'euros</p> <p>Grande entreprise (LARE) – entreprise qui n'est ni une micro, ni une petite ni une moyenne entreprise</p> <p>Personne physique (NATP)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CRPL17	Revenus	<p>Volume de ventes annuelles du débiteur net de toutes remises et taxes sur les achats, conformément à la recommandation 2003/361/CE [l'équivalent du concept de «chiffre d'affaires annuel total» dans l'article 153, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 575/2013].</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON
CRPL18	Total des dettes	<p>Total des dettes brutes du débiteur, y compris le financement fourni pour la présente exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON
CRPL19	EBITDA	<p>Bénéfices récurrents provenant des activités poursuivies plus intérêts, taxes, impôts, dépréciation et amortissement.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON
CRPL20	Valeur de l'entreprise	<p>Valeur de l'entreprise, à savoir capitalisation boursière plus dette, intérêts minoritaires et actions privilégiées, moins la trésorerie totale et équivalents de trésorerie.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL21	Flux de trésorerie disponible	Recettes nettes plus charges hors-trésorerie, intérêts x (1 - taux d'imposition) et investissements à long terme, moins les investissements dans le fonds de roulement. Les charges hors trésorerie incluent la dépréciation, l'amortissement, l'amortissement pour épuisement, la rémunération en actions et la dépréciation d'actifs. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CRPL22	Date des données financières	Date des informations financières (par exemple, EBITDA) sur le débiteur de cette exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CRPL23	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise dans laquelle sont établis les états financiers.	OUI	NON
CRPL24	Type de créance	Type de créance: Prêt ou location (LOLE) Garantie (GUAR) Billets à ordre (PRMS) Droits de participation (PRTR) Découvert (ODFT) Lettre de crédit (LCRE) Facilité de capacité d'exploitation (WCFC) Actions (EQUI) Autre (OTHR)	NON	NON
CRPL25	Éléments titrisés	Quelles créances associées à cette exposition sous-jacente ont été titrisées: Principal et intérêts (PRIN) Principal uniquement (PRPL) Intérêts uniquement (INTR) Autre (OTHR)	NON	NON
CRPL26	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	Code ISIN attribué à l'exposition sous-jacente, le cas échéant.	NON	OUI
CRPL27	Rang	Rang du titre de créance: Dettes de premier rang (SNDB) Dettes mezzanine (MZDD) Dettes de rang inférieur (JUND) Dettes subordonnées (SBOD) Autre (OTHR)	NON	OUI
CRPL28	Syndication	L'exposition sous-jacente est-elle syndiquée?	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL29	Opération à effet de levier	L'exposition sous-jacente est-elle une opération à effet de levier, telle que définie à l'adresse https://www.bankingsupervision.europa.eu/ecb/pub/pdf/ssm.leveraged_transactions_guidance_201705.en.pdf ?	NON	NON
CRPL30	Gestion par CLO	L'exposition sous-jacente est-elle également gérée par le gestionnaire de CLO?	NON	OUI
CRPL31	Paiement en nature	L'exposition sous-jacente est-elle actuellement remboursée en nature (c'est-à-dire, les intérêts sont-ils payés sous forme de principal capitalisé)?	OUI	NON
CRPL32	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
CRPL33	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CRPL34	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI
CRPL35	Canal à l'origine de l'initiation	Canal à l'origine de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Siège ou réseau d'agences (BRAN) Courtier (BROK) Internet (WEBI) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CRPL36	Finalité	But de l'exposition sous-jacente: Découvert ou fonds de roulement (OVRD) Nouvelle installation et investissement dans les équipements (EQPI) Investissement dans les nouvelles technologies de l'information (INFT) Rénovation d'une installation, d'un équipement ou d'une technologie existant(e) (RFBR) Fusion et acquisition (MGAQ) Autre finalité expansionniste (OEXP) Autre (OTHR)	OUI	NON
CRPL37	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CRPL38	Encours initial du capital	Encours initial de l'exposition sous-jacente (commissions incluses). Il s'agit de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL39	Encours actuel du capital	<p>Montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêt des données. Ce montant inclut tous les montants assimilés au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CRPL40	Soldes de principal de rang supérieur	<p>Soldes de principal de rang supérieur à cette exposition sous-jacente (y compris ceux détenus par d'autres prêteurs). S'il n'y a pas de solde de rang supérieur, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
CRPL41	Valeur de marché	<p>Pour les titrisations de titres adossés à des prêts aux entreprises, entrer la valeur de marché de la sûreté.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CRPL42	Montant limite du crédit	<p>Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles (y compris celles présentant des caractéristiques de prêt revolving) ou lorsque le montant maximal de l'exposition sous-jacente n'a pas été retiré en totalité: montant potentiel maximal de l'encours d'exposition.</p> <p>Ce champ ne doit être rempli que pour les expositions sous-jacentes présentant des caractéristiques de prélèvements flexibles ou complémentaires.</p> <p>Il ne s'agit pas de tenir compte des cas où le débiteur peut renégocier une augmentation de l'encours de l'exposition sous-jacente, mais plutôt des cas où, en vertu du contrat, le débiteur a la possibilité de le faire et le prêteur, de fournir le financement supplémentaire.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CRPL43	Prix d'achat	<p>Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.</p>	NON	OUI
CRPL44	Date d'exercice de l'option de vente	<p>S'il existe une option de vente de l'exposition sous-jacente, entrer la date à laquelle l'option peut être exercée. Si la date est inconnue (par exemple, l'option est une option américaine), entrer l'équivalent du 31 décembre 2099.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL45	Prix d'exercice de l'option de vente	<p>S'il existe une option de vente de l'exposition sous-jacente, entre le prix d'exercice de l'option de vente. Si le prix d'exercice est variable (par exemple, l'option est une option «lookback»), entrer la meilleure estimation du prix d'exercice à la date d'arrêté des données.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CRPL46	Type d'amortissement	<p>Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts:</p> <p>Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX)</p> <p>Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX)</p> <p>Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE)</p> <p>In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
CRPL47	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêté des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	OUI	OUI
CRPL48	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	<p>Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements:</p> <p>Mensuel (MNTH)</p> <p>Trimestriel (QUTR)</p> <p>Semestriel (SEMI)</p> <p>Annuel (YEAR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CRPL49	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	<p>Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements:</p> <p>Mensuel (MNTH)</p> <p>Trimestriel (QUTR)</p> <p>Semestriel (SEMI)</p> <p>Annuel (YEAR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
CRPL50	Prochain paiement dû	<p>Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL51	Montant libératoire	Montant total du remboursement du capital (titrisé) à effectuer à la date d'échéance de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CRPL52	Type de taux d'intérêt	Type de taux d'intérêt: Exposition sous-jacente à taux variable (permanent) (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable liée à un indice qui passera à un autre indice dans l'avenir (FINX) Exposition sous-jacente à taux fixe (permanent) (FXRL) Taux fixe avec de futures révisions périodiques (FXPR) Exposition sous-jacente à taux fixe avec un futur passage obligatoire à un taux variable (FLCF) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher (FLIF) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plafond (CAPP) Exposition sous-jacente à taux variable avec une valeur plancher et une valeur plafond (FLIF) Taux d'actualisation (DISC) Option de modification (SWIC) Échange entre débiteurs (OBLS) Modulaire (MODE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CRPL53	Taux d'intérêt actuel	Taux brut annuel utilisé pour calculer les intérêts sur la période courante de l'échéancier de l'exposition sous-jacente titrisée. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI
CRPL54	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
CRPL55	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CRPL56	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI
CRPL57	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL58	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CRPL59	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CRPL60	Marge à la révision 1	Marge pour l'exposition sous-jacente à la première date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI
CRPL61	Date 1 de révision des intérêts	Prochaine date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI
CRPL62	Marge à la révision 2	Marge pour l'exposition sous-jacente à la deuxième date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI
CRPL63	Date 2 de révision des intérêts	Deuxième date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI
CRPL64	Marge à la révision 3	Marge pour l'exposition sous-jacente à la troisième date de révision. Ce champ concerne uniquement les modifications contractuelles de la marge (par exemple, +50 points de base à +100 points de base) ou l'indice sous-jacent (par exemple, 3M EURIBOR à 1M EURIBOR) utilisé pour le calcul des intérêts. Ce champ ne renvoie pas à la date de révision périodique de l'indice (par exemple, révision de l'indice 1M EURIBOR chaque mois). Indiquer la marge révisée totale et non la <i>modification</i> de la marge.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL65	Date 3 de révision des intérêts	Troisième date à laquelle le taux d'intérêt sera modifié (par exemple, modification de la marge d'escompte, fin de la période fixe, réajustement de l'exposition sous-jacente, etc.; il ne s'agit pas de la prochaine date de changement de la valeur de l'indice/LIBOR/EURIBOR).	OUI	OUI
CRPL66	Indice de référence du taux d'intérêt révisé	Prochain indice du taux d'intérêt: MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CRPL67	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt révisé	Échéance du prochain indice de référence du taux d'intérêt: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK)	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)		
CRPL68	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
CRPL69	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI
CRPL70	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CRPL71	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le non-paiement d'intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPL72	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
CRPL73	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
CRPL74	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêt des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CRPL75	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL76	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI
CRPL77	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CRPL78	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêté des données.	NON	NON
CRPL79	Situation du compte	Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée: Performante (PERF) Restructurée – aucun arriéré (RNAR) Restructurée – arriérés (RARR) En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT) Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT) En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR) En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB) Arriérés (ARRE) Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR) Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF) Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE) Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS) Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Remboursée (RDMD) Autre (OTHR) «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.		
CRPL80	Raison du défaut ou de la saisie	Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée: En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX) En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX) En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)	OUI	OUI
CRPL81	Montant du défaut	Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPL82	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
CRPL83	Pertes allouées	Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPL84	Recouvrements cumulés	Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL85	Sources de recouvrement	Sources des recouvrements: Liquidation de sûretés (LCOL) Exécution des garanties (EGAR) Prêts supplémentaires (ALEN) Recouvrements en espèces (CASR) Mixte (MIXD) Autre (OTHR)	NON	OUI
CRPL86	Recours	Y a-t-il recours (complet ou limité) aux actifs du débiteur au-delà du produit réalisé d'une sûreté pour cette exposition sous-jacente?	OUI	OUI
CRPL87	Montant des dépôts	Somme de tous les montants du débiteur détenus par l'initiateur ou le vendeur qui sont potentiellement déductibles de l'encours de l'exposition sous-jacente, à l'exclusion du bénéfice découlant de tout système national de garantie des dépôts. Afin d'empêcher une double comptabilisation, cette somme est plafonnée au plus faible 1) du montant des dépôts et 2) du montant maximal potentiellement déductible au niveau du débiteur (et non au niveau de l'exposition sous-jacente) dans le panier. Utiliser la même devise de libellé que celle utilisée pour cette exposition sous-jacente. Si un débiteur a plus d'un encours dans le panier, alors ce champ doit être complété pour chaque exposition sous-jacente et la décision de répartir le montant des dépôts entre chacune d'entre elles est laissée à la discrétion de l'entité déclarante, sous réserve du plafond susmentionné et aussi longtemps que la somme des entrées de ce champ pour les multiples expositions sous-jacentes est égale à ce montant précis. Par exemple, si un débiteur A a un solde de dépôts de 100 EUR et deux encours dans le panier de: 60 EUR (exposition sous-jacente 1) et de 75 EUR (exposition sous-jacente 2), ce champ doit être complété soit par «exposition sous-jacente 1 – 60 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 40 EUR», soit par «exposition sous-jacente 1 – 25 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 75 EUR» (c'est-à-dire, les entrées relatives de ce champ pour chaque exposition sous-jacente sont plafonnées à 60 EUR pour l'exposition sous-jacente 1 et à 75 EUR pour l'exposition sous-jacente 2 et la somme des valeurs de l'exposition sous-jacente 1 et de l'exposition sous-jacente 2 doit être égale à 100 EUR). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPL88	Notionnel du swap de taux d'intérêt	S'il y a un swap de taux d'intérêt sur l'exposition sous-jacente, entrer le montant notionnel. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL89	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de taux d'intérêt	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur du swap de taux d'intérêt pour l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CRPL90	Fournisseur du swap de taux d'intérêt	S'il y a un swap de taux d'intérêt sur l'exposition sous-jacente, indiquer la dénomination sociale complète du fournisseur du swap de taux d'intérêt. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CRPL91	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	S'il y a un swap de taux d'intérêt sur l'exposition sous-jacente, indiquer la date d'échéance du swap.	NON	OUI
CRPL92	Notionnel du swap de devises	S'il y a un swap de devises sur l'exposition sous-jacente, entrer le montant notionnel. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPL93	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de devises	S'il y a un swap de devises sur l'exposition sous-jacente, indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur du swap.	NON	OUI
CRPL94	Fournisseur du swap de devises	S'il y a un swap de devises sur l'exposition sous-jacente, indiquer la dénomination sociale complète du fournisseur du swap de devises. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
CRPL95	Date d'échéance du swap de devises	S'il y a un swap de devises sur l'exposition sous-jacente, indiquer la date d'échéance du swap.	NON	OUI
CRPL96	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
CRPL97	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
CRPL98	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPL99	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
CRPL100	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CRPL101	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON

Informations au niveau de la sûreté

CRPC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ CRPL1.	NON	NON
CRPC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ CRPL3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPC3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté ou à la garantie. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPC4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ CRPC3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CRPC3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CRPC5	Région géographique – Sûreté	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est située la sûreté. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
CRPC6	Type de sûreté	Type de sûreté: Sûreté réelle (collatéral) (COLL) Garantie adossée à une sûreté réelle (GCOL) Garantie non adossée à une sûreté réelle (GNCO) Autre (OTHR)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPC7	Type de charge	Type de charge constituée sur la sûreté réelle. En cas de garantie, ce champ renvoie à tout type de sûreté sur toute sûreté réelle couvrant cette garantie. «Aucune charge, mais une procuration irrévocable ou une procuration similaire» désigne la situation dans laquelle l'initiateur ou le prêteur initial, le cas échéant, est irrévocablement et inconditionnellement autorisé à créer unilatéralement une charge sur la sûreté réelle à tout moment dans l'avenir, sans qu'aucune autre approbation ne soit nécessaire de la part du débiteur ou du garant: Charge fixe (FXCH) Charge variable (FLCH) Aucune charge (NOCG) Aucune charge mais une procuration irrévocable ou une procuration similaire (ATRN) Autre (OTHR)	NON	OUI
CRPC8	Privilège	Position de privilège la plus élevée détenue par l'initiateur en ce qui concerne la sûreté.	OUI	OUI
CRPC9	Type de sûreté	Principal type d'actif (en termes de valeur) garantissant la dette. Dans le cas de garanties adossées à des sûretés physiques ou financières, se baser sur toutes les sûretés sur lesquelles la garantie est adossée. Automobile (CARX) Véhicule industriel (INDV) Camion commercial (CMTR) Véhicule ferroviaire (RALV) Véhicule nautique commercial (NACM) Véhicule nautique de loisir (NALV) Avion (AERO) Machine-outil (MCHT) Équipement industriel (INDE) Équipement de bureau (OFEQ) Équipement informatique (ITEQ) Équipement médical (MDEQ) Équipement lié à l'énergie (ENEQ) Bâtiment commercial (CBLD) Bâtiment résidentiel (RBLD) Bâtiment industriel (IBLD) Autre véhicule (OTHV) Autre équipement (OTHE) Autre bien immobilier (OTRE) Autres produits ou stocks (OTGI) Titres (SECU) Garantie (GUAR)	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Autre actif financier (OTFA) Catégories mixtes correspondant à une sûreté constituée sur tous les actifs du débiteur (MIXD) Autre (OTHR)		
CRPC10	Montant de la valorisation actuelle	Valorisation la plus récente de la sûreté. Lorsqu'une garantie est adossée à une sûreté physique ou financière, examiner la garantie afin d'identifier la sûreté qui la couvre. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CRPC11	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	Méthode de calcul de la valeur la plus récente de la sûreté, comme indiqué dans le champ CRPC10: Évaluation complète (FAPR) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM) Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire ou agent immobilier (MAEA) Prix d'achat (PPRI) Décote (HCUT) Évaluation au prix du marché (MTTM) Évaluation du débiteur (OBLV) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CRPC12	Date de valorisation actuelle	Date de la valorisation la plus récente de la sûreté, comme indiqué dans le champ CRPC10.	OUI	OUI
CRPC13	Montant de la valorisation initiale	Valorisation initiale de la sûreté à la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CRPC14	Méthode suivie pour la valorisation initiale	Méthode de calcul de la valeur de la sûreté au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente, comme indiqué dans le champ CRPC13: Évaluation complète (FAPR) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM) Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire ou agent immobilier (MAEA) Prix d'achat (PPRI) Décote (HCUT) Évaluation au prix du marché (MTTM) Évaluation du débiteur (OBLV) Autre (OTHR)	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CRPC15	Date de la valorisation initiale	Date de la valorisation initiale de la sûreté physique ou financière, comme indiqué dans le champ CRPC13.	OUI	OUI
CRPC16	Date de la vente	Date de vente de la sûreté.	NON	OUI
CRPC17	Prix de vente	Prix réalisé sur la vente de la sûreté en cas de saisie. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CRPC18	Monnaie de la sûreté	Il s'agit de la devise dans laquelle le montant de la valorisation indiquée dans le champ CRPC10 est libellé.	NON	OUI
CRPC19	Pays du garant	Pays dans lequel est établi le garant.	NON	OUI
CRPC20	Sous-secteur SEC du garant	Classement SEC 2010 du garant conformément au règlement (UE) n° 549/2013 du Parlement européen et du Conseil («SEC 2010») ⁽¹⁾ . Cette entrée doit être fournie au niveau du sous-secteur. Utiliser l'une des valeurs figurant dans le tableau 1 de l'annexe 1 du présent règlement.	NON	OUI

⁽¹⁾ Règlement (UE) n° 549/2013 du Parlement européen et du Conseil du 21 mai 2013 relatif au système européen des comptes nationaux et régionaux dans l'Union européenne (JO L 174 du 26.6.2013, p. 1).



ANNEXE V

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – AUTOMOBILES

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
AUTL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
AUTL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
AUTL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ AUTL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ AUTL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
AUTL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
AUTL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ AUTL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ AUTL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
AUTL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données	NON	NON
AUTL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
AUTL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI
AUTL10	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
AUTL11	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
AUTL12	Situation professionnelle	Situation professionnelle du débiteur principal: Salarié – secteur privé (EMRS) Salarié – secteur public (EMBL) Salarié – secteur inconnu (EMUK) Sans emploi (UNEM) Travailleur indépendant (SFEM) Aucun emploi, le débiteur est une entité juridique (NOEM) Étudiant (STNT) Retraité (PNNR) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL13	Débiteur en difficulté	Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1 du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial:	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:</p> <p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p> <p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
AUTL14	Forme juridique du débiteur	<p>Forme juridique du client:</p> <p>Société anonyme (PUBL)</p> <p>Société à responsabilité limitée (LLCO)</p> <p>Partenariat (PNTR)</p> <p>Particulier (INDV)</p> <p>Entité administrative publique (GOVT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL15	Type de client	Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente: Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO) Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO) Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO) Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (ENEO) Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO) Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL16	Revenu principal	Revenu annuel du débiteur principal utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer les recettes annuelles de ce débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
AUTL17	Type de revenu principal	Indiquer le revenu affiché dans le champ AUTL16: Revenu brut annuel (GRAN) Revenu net annuel (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (NITS) Revenu net annuel (net d'impôts uniquement) (NITX) Revenu net annuel (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (NITN) Revenu net annuel estimé (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (ENIS) Revenu net annuel estimé (net d'impôts uniquement) (EITX) Revenu net annuel estimé (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (EISS) Revenu disponible (DSPL) L'emprunteur est une entité juridique (CORP) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL18	Monnaie du revenu principal	Devise dans laquelle le revenu principal du débiteur est versé. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer la devise du revenu indiqué dans le champ AUTL20.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL19	Vérification du revenu principal	Vérification du revenu principal: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL20	Revenus	Volume de ventes annuelles du débiteur net de toutes remises et taxes sur les achats, conformément à la recommandation 2003/361/CE [l'équivalent du concept de «chiffre d'affaires annuel total» dans l'article 153, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 575/2013]. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
AUTL21	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise dans laquelle sont établis les états financiers.	OUI	OUI
AUTL22	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
AUTL23	Type de produit	Classification du contrat de location, selon la définition du bailleur: Crédit ballon (à un particulier) (PPUR) Location contractuelle (à un particulier) (PHIR) Location avec option d'achat (HIRP) Location-achat (LEAP) Location-financement (FNLS) Location simple (OPLS) Autre (OTHR)	NON	OUI
AUTL24	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
AUTL25	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI
AUTL26	Durée initiale du prêt	Durée contractuelle initiale (en nombre de mois) à la date d'initiation.	OUI	OUI
AUTL27	Canal à l'origine de l'initiation	Canal à l'origine de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Concessionnaire automobile (ADLR) Courtier (BROK) Direct (DIRE) Indirect (IDRT) Autre (OTHR)	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL28	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
AUTL29	Encours initial du capital	Encours sur le capital de l'exposition sous-jacente du débiteur ou encours actualisé du contrat de location (incluant les commissions capitalisées) à l'initiation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
AUTL30	Encours actuel du capital	Encours de l'exposition sous-jacente du débiteur ou encours (actualisé du contrat de location) à la date d'arrêté des données. Il inclut tous les montants obtenus au titre de garantie sur le véhicule. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours et font partie du capital pour la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL31	Prix d'achat	Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.	NON	OUI
AUTL32	Type d'amortissement	Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts: Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX) Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes, y compris l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX) Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE) In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL33	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêté des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
AUTL34	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL35	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
AUTL36	Mode de remboursement	Méthode habituelle de paiement (peut être basée sur le dernier versement reçu): Débit direct (CDTX) Ordre permanent (SORD) Chèque (CHKX) Cash (CASH) Virement bancaire (ni débit direct ni ordre permanent) (BTRA) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL37	Prochain paiement dû	Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL38	Montant libératoire	Montant total du remboursement du capital (titrisé) à effectuer à la date d'échéance de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
AUTL39	Montant de l'apport initial	Montant du dépôt/de l'apport à l'origine de l'exposition sous-jacente (ce montant inclut la valeur de reprise des véhicules repris, etc.). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
AUTL40	Taux d'intérêt actuel	Taux d'intérêt ou d'actualisation brut actuel applicable à l'exposition sous-jacente. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL41	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	<p>Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé):</p> <p>MuniAAA (MAAA)</p> <p>FutureSWAP (FUSW)</p> <p>LIBID (LIBI)</p> <p>LIBOR (LIBO)</p> <p>SWAP (SWAP)</p> <p>Treasury (TREA)</p> <p>Euribor (EURI)</p> <p>Pfandbriefe (PFAN)</p> <p>EONIA (EONA)</p> <p>EONIASwaps (EONS)</p> <p>EURODOLLAR (EUUS)</p> <p>EuroSwiss (EUCH)</p> <p>TIBOR (TIBO)</p> <p>ISDAFIX (ISDA)</p> <p>GCFRepo (GCFR)</p> <p>STIBOR (STBO)</p> <p>BBSW (BBSW)</p> <p>JIBAR (JIBA)</p> <p>BUBOR (BUBO)</p> <p>CDOR (CDOR)</p> <p>CIBOR (CIBO)</p> <p>MOSPRIM (MOSP)</p> <p>NIBOR (NIBO)</p> <p>PRIBOR (PRBO)</p> <p>TELBOR (TLBO)</p> <p>WIBOR (WIBO)</p> <p>Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER)</p> <p>Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR)</p> <p>Taux du prêteur (LDOR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
AUTL42	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	<p>Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel:</p> <p>Au jour le jour (OVNG)</p> <p>Intrajournalier (INDA)</p> <p>1 jour (DAIL)</p> <p>1 semaine (WEEK)</p> <p>2 semaines (WEEK)</p> <p>1 mois (MNTH)</p> <p>2 mois (TOMN)</p> <p>3 mois (QUTR)</p>	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)		
AUTL43	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI
AUTL44	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
AUTL45	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
AUTL46	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
AUTL47	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
AUTL48	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI
AUTL49	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le paiement des intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL50	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
AUTL51	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
AUTL52	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêt des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL53	Fabricant	Nom de la marque du fabricant du véhicule, par exemple entrer «Skoda» et non «Volkswagen».	OUI	NON
AUTL54	Modèle	Nom du modèle du véhicule automobile.	OUI	NON
AUTL55	Année d'immatriculation	Année d'immatriculation du véhicule.	OUI	OUI
AUTL56	De première main ou d'occasion	État du véhicule à l'initiation de l'exposition sous-jacente: De première main (NEWX) D'occasion (USED) Démonstration (DEMO) Autre (OTHR)	OUI	NON
AUTL57	Valeur du certificat de performance énergétique	Valeur du certificat de performance énergétique de la sûreté au moment de l'initiation: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE) F (EPCF) G (EPCG) Autre (OTHR)	OUI	OUI
AUTL58	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur du certificat de performance énergétique. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
AUTL59	Ratio initial prêt/valeur	Ratio de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation par rapport à la valeur automobile à cette date.	OUI	NON
AUTL60	Montant de la valorisation initiale	Prix pratiqué du véhicule à la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Pour une voiture d'occasion, entrer la valeur marchande ou le prix de vente de la voiture. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
AUTL61	Valeur résiduelle initiale du véhicule	Valeur résiduelle estimée de l'actif à la date d'initiation du contrat de location. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL62	Prix à l'exercice de l'option d'achat	Montant que le débiteur devra payer à la fin du contrat de location ou de l'exposition sous-jacente pour prendre possession du véhicule, autre que le versement auquel il est fait référence dans le champ AUTL63. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL63	Valeur résiduelle titrisée	Montant de la valeur résiduelle qui a été titrisée seulement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL64	Valeur résiduelle actualisée du véhicule	Si la valeur résiduelle a été titrisée, entrer la valeur résiduelle estimée la plus récente du véhicule à la fin du contrat. Si aucune actualisation n'a été effectuée, entrer la valeur résiduelle estimée initiale. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
AUTL65	Date d'actualisation de la valeur résiduelle du véhicule	Si la valeur résiduelle a été titrisée, entrer la date la plus récente à laquelle la réévaluation de la valeur résiduelle du véhicule a été effectuée. En l'absence de réévaluation, entrer la date de la valorisation d'origine.	NON	OUI
AUTL66	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
AUTL67	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI
AUTL68	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL69	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêt des données.	NON	NON
AUTL70	Situation du compte	<p>Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée:</p> <p>Performante (PERF)</p> <p>Restructurée – aucun arriéré (RNAR)</p> <p>Restructurée – arriérés (RARR)</p> <p>En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT)</p> <p>Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT)</p> <p>En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR)</p> <p>En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB)</p> <p>Arriérés (ARRE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR)</p> <p>Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF)</p> <p>Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS)</p> <p>Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)</p> <p>Remboursée (RDMD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>	NON	NON
AUTL71	Raison du défaut ou de la saisie	<p>Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée:</p> <p>En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX)</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX)</p> <p>En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)</p>		
AUTL72	Montant du défaut	<p>Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
AUTL73	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
AUTL74	Pertes allouées	<p>Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
AUTL75	Pertes sur la valeur résiduelle	<p>Perte sur la valeur résiduelle constatée à la reprise du véhicule. Si la valeur résiduelle n'a pas été titrisée, entrer ND5.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
AUTL76	Recouvrements cumulés	<p>Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
AUTL77	Prix de vente	<p>Prix réalisé sur la vente du véhicule en cas de saisie.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL78	Montant des dépôts	<p>Somme de tous les montants du débiteur détenus par l'initiateur ou le vendeur qui sont potentiellement déductibles de l'encours de l'exposition sous-jacente, à l'exclusion du bénéfice découlant de tout système national de garantie des dépôts. Afin d'empêcher une double comptabilisation, cette somme doit être plafonnée au plus faible 1) du montant des dépôts et 2) du montant maximal potentiellement déductible au niveau du débiteur (et non au niveau de l'exposition sous-jacente) dans le panier.</p> <p>Utiliser la même devise de libellé que celle utilisée pour cette exposition sous-jacente.</p> <p>Si un débiteur a plus d'un encours dans le panier, alors ce champ doit être complété pour chaque exposition sous-jacente et la décision de répartir le montant des dépôts entre chacune d'entre elles est laissée à la discrétion de l'entité déclarante, sous réserve du plafond susmentionné et aussi longtemps que la somme des entrées de ce champ pour les multiples expositions sous-jacentes est égale à ce montant précis. Par exemple, si un débiteur A a un solde de dépôts de 100 EUR et deux encours dans le panier de: 60 EUR (exposition sous-jacente 1) et de 75 EUR (exposition sous-jacente 2), ce champ doit être complété soit par «exposition sous-jacente 1 – 60 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 40 EUR», soit par «exposition sous-jacente 1 – 25 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 75 EUR» (c'est-à-dire, les entrées relatives de ce champ pour chaque exposition sous-jacente sont plafonnées à 60 EUR pour l'exposition sous-jacente 1 et à 75 EUR pour l'exposition sous-jacente 2 et la somme des valeurs de l'exposition sous-jacente 1 et de l'exposition sous-jacente 2 doit être égale à 100 EUR).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
AUTL79	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
AUTL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
AUTL81	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
AUTL82	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
AUTL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
AUTL84	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON



ANNEXE VI

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – CRÉDITS À LA CONSOMMATION

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
CMRL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
CMRL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CMRL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ CMRL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CMRL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CMRL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CMRL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ CMRL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CMRL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CMRL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
CMRL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CMRL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI
CMRL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL10	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
CMRL11	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
CMRL12	Situation professionnelle	Situation professionnelle du débiteur principal: Salarié – secteur privé (EMRS) Salarié – secteur public (EMBL) Salarié – secteur inconnu (EMUK) Sans emploi (UNEM) Travailleur indépendant (SFEM) Aucun emploi, le débiteur est une entité juridique (NOEM) Étudiant (STNT) Retraité (PNNR) Autre (OTHR)	OUI	NON
CMRL13	Débiteur en difficulté	Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial: a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p> <p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
CMRL14	Type de client	<p>Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO)</p> <p>Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (ENEO)</p> <p>Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO)</p> <p>Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL15	Revenu principal	Revenu annuel du débiteur principal utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer les recettes annuelles de ce débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CMRL16	Type de revenu principal	Indiquer le revenu affiché dans le champ CMRL15: Revenu brut annuel (GRAN) Revenu net annuel (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (NITS) Revenu net annuel (net d'impôts uniquement) (NITX) Revenu net annuel (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (NITN) Revenu net annuel estimé (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (ENIS) Revenu net annuel estimé (net d'impôts uniquement) (EITX) Revenu net annuel estimé (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (EISS) Revenu disponible (DSPL) L'emprunteur est une entité juridique (CORP) Autre (OTHR)	OUI	NON
CMRL17	Monnaie du revenu principal	Devise dans laquelle le revenu principal du débiteur est versé.	OUI	NON
CMRL18	Vérification du revenu principal	Vérification du revenu principal: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	NON
CMRL19	Garanti par un salaire/une pension	L'exposition sous-jacente personnelle relève-t-elle de la catégorie des expositions sous-jacentes adossées à la retraite/au salaire (à savoir, cessione del quinto)?	OUI	NON
CMRL20	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL21	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	NON
CMRL22	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI
CMRL23	Durée initiale du prêt	Durée contractuelle initiale (en nombre de mois) à la date d'initiation.	OUI	OUI
CMRL24	Canal à l'origine de l'initiation	Canal de l'initiation: Internet (WEBI) Succursale (BRCH) Vente par téléphone (TSL) Stand (STND) Courrier (POST) Marque blanche (WLBL) Magazine (MGZN) Concessionnaire automobile (ADLR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CMRL25	Finalité	But du prêt: Éducation (TUIT) Frais de subsistance (LEXP) Médical (MDCL) Aménagement intérieur (HIMP) Appareil ou mobilier (AFPR) Voyage (TRVL) Consolidation de dette (DCON) Voiture de première main (NCAR) Voiture d'occasion (UCAR) Autre véhicule (OTHV) Équipement (EQU) Bien (PROP) Autre (OTHR)	OUI	NON
CMRL26	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CMRL27	Encours initial du capital	Encours initial du capital de l'exposition sous-jacente (y compris les commissions capitalisées) à l'initiation. Il s'agit de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL28	Encours actuel du capital	<p>Montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêté des données. Ce montant inclut tous les montants assimilés au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours et font partie du capital pour la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CMRL29	Montant limite du crédit	<p>Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles (y compris celles présentant des caractéristiques de prêt revolving) ou lorsque le montant maximal de l'exposition sous-jacente n'a pas été retiré en totalité: montant potentiel maximal de l'encours d'exposition.</p> <p>Ce champ ne doit être rempli que pour les expositions sous-jacentes présentant des caractéristiques de prélèvements flexibles ou complémentaires.</p> <p>Il ne s'agit pas de tenir compte des cas où le débiteur peut renégocier une augmentation de l'encours de l'exposition sous-jacente, mais plutôt des cas où, en vertu du contrat, le débiteur a la possibilité de le faire et le prêteur, de fournir le financement supplémentaire.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CMRL30	Date de fin de la période de renouvellement	<p>Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles/ayant des caractéristiques de prêt revolving – date à laquelle les possibilités de prélèvement flexible s'éteignent c'est-à-dire l'expiration de la période de crédit revolving.</p>	NON	OUI
CMRL31	Prix d'achat	<p>Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.</p>	NON	OUI
CMRL32	Type d'amortissement	<p>Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts:</p> <p>Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX)</p> <p>Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX)</p> <p>Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE)</p> <p>In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL33	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
CMRL34	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CMRL35	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CMRL36	Prochain paiement dû	Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CMRL37	Taux d'intérêt actuel	Taux brut annuel utilisé pour calculer les intérêts sur la période courante de l'échéancier de l'exposition sous-jacente titrisée. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI
CMRL38	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
CMRL39	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CMRL40	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI
CMRL41	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CMRL42	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL43	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CMRL44	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
CMRL45	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI
CMRL46	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
CMRL47	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le non-paiement d'intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CMRL48	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
CMRL49	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
CMRL50	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêt des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
CMRL51	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
CMRL52	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL53	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
CMRL54	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêté des données.	NON	NON
CMRL55	Situation du compte	Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée: Performante (PERF) Restructurée – aucun arriéré (RNAR) Restructurée – arriérés (RARR) En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT) Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT) En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR) En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB) Arriérés (ARRE) Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR) Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF) Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE) Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS) Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT) Remboursée (RDMD) Autre (OTHR)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaires de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.		
CMRL56	Raison du défaut ou de la saisie	Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée: En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX) En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX) En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)	OUI	OUI
CMRL57	Montant du défaut	Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CMRL58	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
CMRL59	Pertes allouées	Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CMRL60	Recouvrements cumulés	Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL61	Montant des dépôts	<p>Somme de tous les montants du débiteur détenus par l'initiateur ou le vendeur qui sont potentiellement déductibles de l'encours de l'exposition sous-jacente, à l'exclusion du bénéfice découlant de tout système national de garantie des dépôts. Afin d'empêcher une double comptabilisation, cette somme doit être plafonnée au plus faible 1) du montant des dépôts et 2) du montant maximal potentiellement déductible au niveau du débiteur (et non au niveau de l'exposition sous-jacente) dans le panier.</p> <p>Utiliser la même devise de libellé que celle utilisée pour cette exposition sous-jacente.</p> <p>Si un débiteur a plus d'un encours dans le panier, alors ce champ doit être complété pour chaque exposition sous-jacente et la décision de répartir le montant des dépôts entre chacune d'entre elles est laissée à la discrétion de l'entité déclarante, sous réserve du plafond susmentionné et aussi longtemps que la somme des entrées de ce champ pour les multiples expositions sous-jacentes est égale à ce montant précis. Par exemple, si un débiteur A a un solde de dépôts de 100 EUR et deux encours dans le panier de: 60 EUR (exposition sous-jacente 1) et de 75 EUR (exposition sous-jacente 2), ce champ doit être complété soit par «exposition sous-jacente 1 – 60 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 40 EUR», soit par «exposition sous-jacente 1 – 25 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 75 EUR» (c'est-à-dire, les entrées relatives de ce champ pour chaque exposition sous-jacente sont plafonnées à 60 EUR pour l'exposition sous-jacente 1 et à 75 EUR pour l'exposition sous-jacente 2 et la somme des valeurs de l'exposition sous-jacente 1 et de l'exposition sous-jacente 2 doit être égale à 100 EUR).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CMRL62	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
CMRL63	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
CMRL64	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CMRL65	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
CMRL66	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CMRL67	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CMRL68	Valeur du certificat de performance énergétique	Valeur du certificat de performance énergétique de la sûreté au moment de l'initiation: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE) F (EPCF) G (EPCG) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CMRL69	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur du certificat de performance énergétique. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI



ANNEXE VII

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – CARTES DE CRÉDIT

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
CCDL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
CCDL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CCDL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ CCDL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CCDL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CCDL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CCDL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ CCDL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ CCDL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
CCDL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
CCDL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
CCDL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL9	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
CCDL10	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
CCDL11	Situation professionnelle	Situation professionnelle du débiteur principal: Salarié – secteur privé (EMRS) Salarié – secteur public (EMBL) Salarié – secteur inconnu (EMUK) Sans emploi (UNEM) Travailleur indépendant (SFEM) Aucun emploi, le débiteur est une entité juridique (NOEM) Étudiant (STNT) Retraité (PNNR) Autre (OTHR)	OUI	NON
CCDL12	Débiteur en difficulté	Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial: a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p> <p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
CCDL13	Type de client	<p>Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO)</p> <p>Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (ENEO)</p> <p>Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO)</p> <p>Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL14	Revenu principal	Revenu annuel du débiteur principal utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer les recettes annuelles de ce débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
CCDL15	Type de revenu principal	Indiquer le revenu affiché dans le champ CCDL14: Revenu brut annuel (GRAN) Revenu net annuel (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (NITS) Revenu net annuel (net d'impôts uniquement) (NITX) Revenu net annuel (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (NITN) Revenu net annuel estimé (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (ENIS) Revenu net annuel estimé (net d'impôts uniquement) (EITX) Revenu net annuel estimé (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (EISS) Revenu disponible (DSPL) L'emprunteur est une entité juridique (CORP) Autre (OTHR)	OUI	NON
CCDL16	Monnaie du revenu principal	Devise dans laquelle le revenu ou les recettes du débiteur principal est/sont versé(es).	OUI	NON
CCDL17	Vérification du revenu principal	Vérification du revenu principal: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	NON
CCDL18	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
CCDL19	Date d'initiation	Date à laquelle le compte a été ouvert.	OUI	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL20	Canal à l'origine de l'initiation	Canal de l'initiation: Internet (WEBI) Succursale (BRCH) Vente par téléphone (TSL) Stand (STND) Courrier (POST) Marque blanche (WLBL) Magazine (MGZN) Autre (OTHR)	OUI	OUI
CCDL21	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CCDL22	Encours actuel du capital	Entrer le montant total actuellement dû par le débiteur (commissions et intérêts inclus) au titre de ce compte. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CCDL23	Montant limite du crédit	Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles (y compris celles présentant des caractéristiques de prêt revolving) ou lorsque le montant maximal de l'exposition sous-jacente n'a pas été retiré en totalité: montant potentiel maximal de l'encours d'exposition. Ce champ ne doit être rempli que pour les expositions sous-jacentes présentant des caractéristiques de prélèvements flexibles ou complémentaires. Il ne s'agit pas de tenir compte des cas où le débiteur peut renégocier une augmentation de l'encours de l'exposition sous-jacente, mais plutôt des cas où, en vertu du contrat, le débiteur a la possibilité de le faire et le prêteur, de fournir le financement supplémentaire. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CCDL24	Prix d'achat	Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.	NON	OUI
CCDL25	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
CCDL26	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL27	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
CCDL28	Prochain paiement dû	Prochain versement minimal périodique dû par le débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
CCDL29	Taux d'intérêt actuel	Rendement moyen pondéré annualisé incluant toutes les commissions applicables à la dernière date de facturation (c'est-à-dire le facturé, pas le perçu).	NON	OUI
CCDL30	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
CCDL31	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
CCDL32	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
CCDL33	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
CCDL34	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du compte.	OUI	OUI
CCDL35	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que le compte est en arriéré à partir de la date d'arrêt des données. Si le compte n'est pas en arriéré, entrer 0.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL36	Encours des arriérés	<p>Encours actuel des arriérés, défini en tant que:</p> <p>total des versements arrivés à échéance</p> <p>PLUS tout montant capitalisé</p> <p>PLUS toute commission appliquée au compte</p> <p>MOINS total des versements reçus à ce jour</p> <p>S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	NON
CCDL37	Situation du compte	<p>Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée:</p> <p>Performante (PERF)</p> <p>Restructurée – aucun arriéré (RNAR)</p> <p>Restructurée – arriérés (RARR)</p> <p>En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT)</p> <p>Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT)</p> <p>En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR)</p> <p>En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB)</p> <p>Arriérés (ARRE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR)</p> <p>Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF)</p> <p>Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS)</p> <p>Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)</p> <p>Remboursée (RDMD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL38	Raison du défaut ou de la saisie	<p>Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée:</p> <p>En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX)</p> <p>En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX)</p> <p>En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)</p>	OUI	OUI
CCDL39	Montant du défaut	<p>Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CCDL40	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
CCDL41	Recouvrements cumulés	<p>Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
CCDL42	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
CCDL43	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	<p>Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial.</p> <p>S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.</p>	OUI	OUI
CCDL44	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
CCDL45	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
CCDL46	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
CCDL47	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON



ANNEXE VIII

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – ► C1 CONTRATS DE LOCATION ◀

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
LESL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
LESL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
LESL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ LESL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ LESL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
LESL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
LESL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ LESL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ LESL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
LESL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
LESL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
LESL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI
LESL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL10	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	NON
LESL11	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	NON
LESL12	Débiteur en difficulté	<p>Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial:</p> <p>a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:</p> <p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
LESL13	Segment du débiteur selon Bâle III	<p>Segment du débiteur selon Bâle III:</p> <p>Entreprises (CORP)</p> <p>Petites et moyennes entreprises considérées comme des entreprises (SMEX)</p> <p>Commerce de détail (RETL)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	OUI
LESL14	Type de client	<p>Type de client à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>Nouveau client et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CNEO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (CEMO)</p> <p>Nouveau client et salarié/affiliation non enregistrée (CNRO)</p> <p>Client existant et non salarié/affilié du groupe de l'initiateur (Eneo)</p> <p>Client existant et salarié/affilié du groupe de l'initiateur (EEMO)</p> <p>Client existant et salarié/affiliation non enregistrée (ENRO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
LESL15	Code NACE de l'activité	Code NACE de l'activité du preneur, conformément au règlement (CE) n° 1893/2006.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL16	Taille de l'entreprise	Classification des entreprises par taille, conformément à l'annexe de la recommandation 2003/361/CE de la Commission: Micro-entreprise (MICE) – entreprise qui occupe moins de 10 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel ou le total du bilan annuel n'excède pas 2 millions d'euros Petite entreprise (SMAE) – entreprise qui occupe moins de 50 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel ou le total du bilan annuel n'excède pas 10 millions d'euros Moyenne entreprise (MEDE) – entreprise qui occupe moins de 250 personnes et dont le chiffre d'affaires annuel n'excède pas 50 millions d'euros ou dont le total du bilan annuel n'excède pas 43 millions d'euros Grande entreprise (LARE) – entreprise qui n'est ni une micro, ni une petite ni une moyenne entreprise Personne physique (NATP) Autre (OTHR)	OUI	OUI
LESL17	Revenus	Volume de ventes annuelles du débiteur net de toutes remises et taxes sur les achats, conformément à la recommandation 2003/361/CE [l'équivalent du concept de «chiffre d'affaires annuel total» dans l'article 153, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 575/2013]. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL18	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise dans laquelle sont établis les états financiers.	OUI	OUI
LESL19	Type de produit	Classification de l'exposition sous-jacente, selon la définition du preneur: Crédit ballon (à un particulier) (PPUR) Location contractuelle (à un particulier) (PHIR) Location avec option d'achat (HIRP) Location-achat (LEAP) Location-financement (FNLS) Location simple (OPLS) Autre (OTHR)	NON	OUI
LESL20	Syndication	L'exposition sous-jacente est-elle syndiquée?	OUI	NON
LESL21	Dispositif particulier	Si l'exposition sous-jacente est régie par un dispositif public particulier, entrer ici le nom entier (sans abréviation) du dispositif.	OUI	OUI
LESL22	Date d'initiation	Date de l'avance initiale du contrat de location.	OUI	NON
LESL23	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL24	Durée initiale du prêt	Durée contractuelle initiale (en nombre de mois) à la date d'initiation.	OUI	OUI
LESL25	Canal à l'origine de l'initiation	Canal à l'origine de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Siège ou réseau d'agences (BRAN) Courtier (BROK) Internet (WEBI) Autre (OTHR)	OUI	OUI
LESL26	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
LESL27	Encours initial du capital	Encours initial du capital (ou après dépréciation) du contrat de location (y compris les commissions capitalisées) à l'initiation. Il s'agit de l'encours du contrat de location à la date d'initiation de celle-ci, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL28	Encours actuel du capital	Encours ou encours actualisé du contrat de location du débiteur à la date d'arrêt des données. Il doit inclure tous les montants obtenus au titre de garantie sur l'actif. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours et font partie du capital pour la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL29	Prix d'achat	Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.	NON	OUI
LESL30	Valeur résiduelle titrisée	Montant de la valeur résiduelle qui a été titrisée seulement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL31	Type d'amortissement	Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts: Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX) Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX)	OUI	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE)</p> <p>In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>		
LESL32	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal.	NON	OUI
LESL33	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	<p>Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements:</p> <p>Mensuel (MNTH)</p> <p>Trimestriel (QUTR)</p> <p>Semestriel (SEMI)</p> <p>Annuel (YEAR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
LESL34	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	<p>Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements:</p> <p>Mensuel (MNTH)</p> <p>Trimestriel (QUTR)</p> <p>Semestriel (SEMI)</p> <p>Annuel (YEAR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
LESL35	Prochain paiement dû	<p>Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
LESL36	Taux d'intérêt actuel	Taux d'intérêt brut total actuel ou taux d'actualisation courant applicable à l'exposition sous-jacente. Les taux calculés sur une base périodique doivent être annualisés.	NON	OUI
LESL37	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	<p>Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé):</p> <p>MuniAAA (MAAA)</p> <p>FutureSWAP (FUSW)</p> <p>LIBID (LIBI)</p> <p>LIBOR (LIBO)</p> <p>SWAP (SWAP)</p> <p>Treasury (TREA)</p> <p>Euribor (EURI)</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
LESL38	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
LESL39	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL40	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
LESL41	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur un bail à taux variable tel que requis dans les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
LESL42	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur un bail à taux variable tel que requis dans les conditions du contrat de location.	NON	OUI
LESL43	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	NON
LESL44	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI
LESL45	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
LESL46	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le paiement des intérêts jusqu'à la date de paiement au titre du bail. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL47	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
LESL48	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
LESL49	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêté des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL50	Prix à l'exercice de l'option d'achat	Le montant que le preneur devra payer à la fin du contrat de location pour prendre possession de l'actif, autre que le versement auquel il est fait référence dans le champ LESL30. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL51	Montant de l'apport initial	Montant du dépôt/apport versé à l'initiation de l'exposition sous-jacente (ce montant inclut la valeur des aménagements repris, etc.). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL52	Valeur résiduelle actuelle de l'actif	Valeur résiduelle prévisionnelle la plus récente de l'actif à la fin du contrat de location. Si aucune actualisation n'a été effectuée, entrer la valeur résiduelle estimée initiale. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL53	Date de restructuration	Entrer la date à laquelle l'exposition sous-jacente a été restructurée. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation. En cas de dates multiples, toutes les dates doivent être indiquées conformément au schéma XML.	OUI	OUI
LESL54	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI
LESL55	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
LESL56	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêt des données.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL57	Situation du compte	<p>Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée:</p> <p>Performante (PERF)</p> <p>Restructurée – aucun arriéré (RNAR)</p> <p>Restructurée – arriérés (RARR)</p> <p>En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT)</p> <p>Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT)</p> <p>En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR)</p> <p>En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB)</p> <p>Arriérés (ARRE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR)</p> <p>Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF)</p> <p>Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS)</p> <p>Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)</p> <p>Remboursée (RDMD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaires de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>	NON	NON
LESL58	Raison du défaut ou de la saisie	<p>Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée:</p> <p>En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX)</p> <p>En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX)</p> <p>En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL59	Montant du défaut	Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL60	Date du défaut	Date du défaut.	NON	OUI
LESL61	Pertes allouées	Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL62	Recouvrements cumulés	Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
LESL63	Sources de recouvrement	Sources des recouvrements: Liquidation de sûretés (LCOL) Exécution des garanties (EGAR) Prêts supplémentaires (ALEN) Recouvrements en espèces (CASR) Mixte (MIXD) Autre (OTHR)	NON	OUI
LESL64	Montant des dépôts	Somme de tous les montants du débiteur détenus par l'initiateur ou le vendeur qui sont potentiellement déductibles de l'encours de l'exposition sous-jacente, à l'exclusion du bénéfice découlant de tout système national de garantie des dépôts. Afin d'empêcher une double comptabilisation, cette somme doit être plafonnée au plus faible 1) du montant des dépôts et 2) du montant maximal potentiellement déductible au niveau du débiteur (et non au niveau de l'exposition sous-jacente) dans le panier. Utiliser la même devise de libellé que celle utilisée pour cette exposition sous-jacente.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Si un débiteur a plus d'un encours dans le panier, alors ce champ doit être complété pour chaque exposition sous-jacente et la décision de répartir le montant des dépôts entre chacune d'entre elles est laissée à la discrétion de l'entité déclarante, sous réserve du plafond susmentionné et aussi longtemps que la somme des entrées de ce champ pour les multiples expositions sous-jacentes est égale à ce montant précis. Par exemple, si un débiteur A a un solde de dépôts de 100 EUR et deux encours dans le panier de: 60 EUR (exposition sous-jacente 1) et de 75 EUR (exposition sous-jacente 2), ce champ doit être complété soit par «exposition sous-jacente 1 – 60 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 40 EUR», soit par «exposition sous-jacente 1 – 25 EUR» et par «exposition sous-jacente 2 – 75 EUR» (c'est-à-dire, les entrées relatives de ce champ pour chaque exposition sous-jacente sont plafonnées à 60 EUR pour l'exposition sous-jacente 1 et à 75 EUR pour l'exposition sous-jacente 2 et la somme des valeurs de l'exposition sous-jacente 1 et de l'exposition sous-jacente 2 doit être égale à 100 EUR).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>		
LESL65	Région géographique – Sûreté	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé l'actif. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
LESL66	Fabricant	Nom du fabricant de l'actif.	OUI	NON
LESL67	Modèle	Nom de l'actif/du modèle.	OUI	NON
LESL68	Année de fabrication/construction	Année de fabrication.	OUI	OUI
LESL69	De première main ou d'occasion	<p>État de l'actif à l'initiation de l'exposition sous-jacente:</p> <p>De première main (NEWX)</p> <p>D'occasion (USED)</p> <p>Démonstration (DEMO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	NON
LESL70	Valeur résiduelle initiale de l'actif	<p>Valeur résiduelle estimée de l'actif à la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL71	Type de sûreté	Principal type d'actif (en termes de valeur) garantissant l'exposition sous-jacente: Automobile (CARX) Véhicule industriel (INDV) Camion commercial (CMTR) Véhicule ferroviaire (RALV) Véhicule nautique commercial (NACM) Véhicule nautique de loisir (NALV) Avion (AERO) Machine-outil (MCHT) Équipement industriel (INDE) Équipement de bureau (OFEQ) Équipement médical (MDEQ) Équipement lié à l'énergie (ENEQ) Bâtiment commercial (CBLD) Bâtiment résidentiel (RBLD) Bâtiment industriel (IBLD) Autre véhicule (OTHV) Autre équipement (OTHE) Autre bien immobilier (OTRE) Autres produits ou stocks (OTGI) Titre (SECU) Garantie (GUAR) Autre actif financier (OTFA) Équipement informatique (ITEQ) Catégories mixtes correspondant à une sûreté constituée sur tous les actifs du débiteur (MIXD) Autre (OTHR)	NON	NON
LESL72	Montant de la valorisation initiale	Valorisation de l'actif à l'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	NON
LESL73	Méthode suivie pour la valorisation initiale	Méthode de calcul de la valeur de l'actif au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Évaluation complète (FAPR) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM)	OUI	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire ou agent immobilier (MAEA) Prix d'achat (PPRI) Décote (HCUT) Autre (OTHR)		
LESL74	Date de la valorisation initiale	Date de la valorisation de l'actif à l'initiation.	OUI	NON
LESL75	Montant de la valorisation actuelle	Montant de la dernière valorisation de l'actif. En l'absence de nouvelle valorisation depuis l'initiation, entrer la date de la valorisation initiale. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
LESL76	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	Méthode de calcul de la valeur la plus récente de l'actif. En l'absence de nouvelle valorisation depuis l'initiation, entrer le type de la valorisation initiale: Évaluation complète (FAPR) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM) Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire ou agent immobilier (MAEA) Prix d'achat (PPRI) Décote (HCUT) Autre (OTHR)	OUI	NON
LESL77	Date de valorisation actuelle	Date la plus récente de la valorisation de l'actif. En l'absence de nouvelle valorisation depuis l'initiation, entrer la date de la valorisation initiale.	OUI	OUI
LESL78	Nombre d'objets loués	Nombre d'actifs individuels couverts par cette exposition sous-jacente.	OUI	NON
LESL79	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI
LESL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
LESL81	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI
LESL82	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
LESL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
LESL84	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON



ANNEXE IX

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – MONTAGES ÉSOTÉRIQUES

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur les expositions sous-jacentes				
ESTL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
ESTL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ ESTL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ ESTL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ ESTL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ ESTL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
ESTL7	Date de l'ajout au panier	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été transférée à la SSPE. Pour toutes les expositions sous-jacentes du panier à la date d'arrêt des données dans le premier rapport présenté au référentiel des titrisations, si cette information n'est pas disponible, entrer la date la plus tardive entre: i) la date de clôture de la titrisation et ii) la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
ESTL8	Date de rachat	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a été rachetée dans le panier.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL9	Date de remboursement	Date à laquelle le compte a été soldé ou à laquelle la procédure de recouvrement s'est terminée (pour les expositions sous-jacentes en défaut).	NON	OUI
ESTL10	Description	Décrire en quelques mots l'exposition sous-jacente (par exemple, «créances sur les tarifs d'électricité», «futur flux»). Toutes les expositions sous-jacentes de ce type doivent être décrites en des termes identiques dans la communication de données.	NON	NON
ESTL11	Région géographique – Débiteur	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est situé le débiteur. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
ESTL12	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	OUI
ESTL13	Situation professionnelle	Situation professionnelle du débiteur principal: Salarié – secteur privé (EMRS) Salarié – secteur public (EMBL) Salarié – secteur inconnu (EMUK) Sans emploi (UNEM) Travailleur indépendant (SFEM) Aucun emploi, le débiteur est une entité juridique (NOEM) Étudiant (STNT) Retraité (PNNR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL14	Débiteur en difficulté	Confirmer que, conformément à l'article 20, paragraphe 11, du règlement (UE) 2017/2402, au moment de la sélection de cette exposition sous-jacente aux fins de son transfert à la SSPE, l'exposition n'était pas en défaut au sens de l'article 178, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 575/2013 ni ne constituait une exposition à un débiteur ou un garant en difficulté qui, au mieux des connaissances de l'initiateur ou prêteur initial:	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>a) a été déclaré insolvable, ou a vu une juridiction accorder à ses créanciers un droit à exécution définitif et non susceptible de recours, ou des dommages-intérêts matériels en raison d'un défaut de paiement dans les trois années précédant la date de l'initiation, ou a fait l'objet d'une procédure de restructuration de dette pour ses expositions non performantes dans les trois années précédant la date du transfert ou de la cession des expositions sous-jacentes à la SSPE, sauf si:</p> <p>i) une exposition sous-jacente restructurée n'a pas présenté de nouveaux arriérés depuis la date de la restructuration, qui doit avoir eu lieu au moins un an avant la date de transfert ou de cession des expositions sous-jacentes à la SSPE; et</p> <p>ii) les informations fournies par l'initiateur, le sponsor et la SSPE conformément à l'article 7, paragraphe 1, premier alinéa, points a) et e) i), précisent la proportion d'expositions sous-jacentes restructurées, le moment et les modalités de la restructuration ainsi que leur performance depuis la date de la restructuration;</p> <p>b) figurait, au moment de l'initiation, le cas échéant, dans un registre public des crédits concernant des personnes ayant des antécédents négatifs en matière de crédit ou, lorsqu'il n'y a pas de tel registre public des crédits, un autre registre des crédits accessible à l'initiateur ou au prêteur initial; ou</p> <p>c) a fait l'objet d'une évaluation du crédit ou d'une évaluation du risque de crédit montrant que le risque que les paiements convenus contractuellement ne soient pas honorés est nettement plus élevé que pour des expositions comparables détenues par l'initiateur qui ne sont pas titrisées.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>		
ESTL15	Forme juridique du débiteur	<p>Forme juridique du client:</p> <p>Société anonyme (PUBL)</p> <p>Société à responsabilité limitée (LLCO)</p> <p>Partenariat (PNTR)</p> <p>Particulier (INDV)</p> <p>Entité administrative publique (GOVT)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL16	Code NACE de l'activité	Code NACE de l'activité du débiteur, conformément au règlement (CE) n° 1893/2006.	OUI	OUI
ESTL17	Revenu principal	Revenu annuel du débiteur principal utilisé pour souscrire l'exposition sous-jacente au moment de l'initiation. Lorsque le débiteur principal est une personne morale/entité juridique, entrer le revenu annuel de ce débiteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL18	Type de revenu principal	Indiquer le revenu affiché dans le champ ESTL17: Revenu brut annuel (GRAN) Revenu net annuel (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (NITS) Revenu net annuel (net d'impôts uniquement) (NITX) Revenu net annuel (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (NITN) Revenu net annuel estimé (net d'impôts et de prélèvements de sécurité sociale) (ENIS) Revenu net annuel estimé (net d'impôts uniquement) (EITX) Revenu net annuel estimé (net de prélèvements de sécurité sociale uniquement) (EISS) Revenu disponible (DSPL) L'emprunteur est une entité juridique (CORP) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL19	Monnaie du revenu principal	Devise dans laquelle le revenu ou les recettes du débiteur principal est/sont versé(es).	OUI	OUI
ESTL20	Vérification du revenu principal	Vérification du revenu principal: Autocertifié sans contrôle (SCRT) Autocertifié avec confirmation d'accessibilité (SCNF) Vérifié (VRFD) Revenu non vérifié ou vérification accélérée (NVRF) Informations ou score transmis par une agence d'évaluation du crédit (SCRG) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL21	Revenus	Volume de ventes annuelles du débiteur net de toutes remises et taxes sur les achats, conformément à la recommandation 2003/361/CE [l'équivalent du concept de «chiffre d'affaires annuel total» dans l'article 153, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 575/2013]. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL22	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise dans laquelle sont établis les états financiers.	OUI	OUI
ESTL23	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	Code ISIN attribué à l'exposition sous-jacente, le cas échéant.	OUI	OUI
ESTL24	Date d'initiation	Date de création initiale de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
ESTL25	Date d'échéance	Date d'échéance de l'exposition sous-jacente ou d'expiration du contrat de location.	OUI	OUI
ESTL26	Monnaie de libellé	Libellé de la devise de l'exposition sous-jacente.	NON	OUI
ESTL27	Encours initial du capital	Encours initial du capital de l'exposition sous-jacente (y compris les commissions capitalisées) à l'initiation. Il s'agit de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'initiation, et non à la date de vente de l'exposition sous-jacente à la SSPE ou la date de clôture de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL28	Encours actuel du capital	Montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêt des données. Ce montant inclut tous les montants assimilés au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL29	Montant limite du crédit	Pour les expositions sous-jacentes pouvant faire l'objet de prélèvements successifs flexibles (y compris celles présentant des caractéristiques de prêt revolving) ou lorsque le montant maximal de l'exposition sous-jacente n'a pas été retiré en totalité: montant potentiel maximal de l'encours d'exposition. Ce champ ne doit être rempli que pour les expositions sous-jacentes présentant des caractéristiques de prélèvements flexibles ou complémentaires. Il ne s'agit pas de tenir compte des cas où le débiteur peut renégocier une augmentation de l'encours de l'exposition sous-jacente, mais plutôt des cas où, en vertu du contrat, le débiteur a la possibilité de le faire et le prêteur, de fournir le financement supplémentaire. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL30	Prix d'achat	Entrer le prix, par rapport au pair, auquel l'exposition sous-jacente a été achetée par la SSPE. Entrer 100 si aucune décote n'a été appliquée.	NON	OUI
ESTL31	Type d'amortissement	Type d'amortissement de l'exposition sous-jacente incluant le principal et les intérêts: Français: à savoir, amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique (FRXX) Allemand: à savoir, amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes et incluent l'amortissement du capital et les intérêts (DEXX) Calendrier d'amortissement fixe: à savoir, amortissement selon lequel le montant du principal remboursé à chaque tranche est identique (FIXE) In fine: à savoir, amortissement selon lequel le montant total du principal est remboursé à la dernière tranche (BLLT) Autre (OTHR)	OUI	NON
ESTL32	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	Le cas échéant à la date d'arrêt des données, indiquer la date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	OUI	OUI
ESTL33	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	Périodicité des versements du capital dû, c'est-à-dire période entre les versements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL34	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	Périodicité des paiements des intérêts dus, c'est-à-dire période entre les paiements: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL35	Prochain paiement dû	Il s'agit du prochain paiement contractuel dû par le débiteur conformément à la périodicité des paiements de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL36	Ratio de la dette au revenu	<p>Dette définie en tant que montant de l'encours de l'exposition sous-jacente à la date d'arrêté des données. Ce montant doit inclure tous les montants garantis par l'hypothèque et sera assimilé au capital dans la transaction. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités.</p> <p>Revenu défini comme dans le code du champ ESTL17, plus tout autre revenu concerné (par exemple, revenu secondaire).</p>	OUI	OUI
ESTL37	Montant libératoire	<p>Montant total du remboursement du capital (titrisé) à effectuer à la date d'échéance de l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
ESTL38	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	Nombre de mois entre deux dates de révision consécutives du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
ESTL39	Taux d'intérêt actuel	Taux d'intérêt courant.	OUI	OUI
ESTL40	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	<p>Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé):</p> <p>MuniAAA (MAAA)</p> <p>FutureSWAP (FUSW)</p> <p>LIBID (LIBI)</p> <p>LIBOR (LIBO)</p> <p>SWAP (SWAP)</p> <p>Treasury (TREA)</p> <p>Euribor (EURI)</p> <p>Pfandbriefe (PFAN)</p> <p>EONIA (EONA)</p> <p>EONIASwaps (EONS)</p> <p>EURODOLLAR (EUUS)</p> <p>EuroSwiss (EUCH)</p> <p>TIBOR (TIBO)</p> <p>ISDAFIX (ISDA)</p> <p>GCFRepo (GCFR)</p> <p>STIBOR (STBO)</p> <p>BBSW (BBSW)</p> <p>JIBAR (JIBA)</p> <p>BUBOR (BUBO)</p>	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
ESTL41	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTL42	Marge de taux d'intérêt actuelle	Marge actuelle du taux d'intérêt de l'exposition sous-jacente à taux variable. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur du taux de l'indice.	OUI	OUI
ESTL43	Valeur plafond du taux d'intérêt	Taux maximal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
ESTL44	Valeur plancher du taux d'intérêt	Taux minimal à payer par le débiteur sur une exposition sous-jacente à taux variable selon les conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
ESTL45	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	Entrer le nombre de paiements effectués avant le transfert de l'exposition pour la titrisation.	OUI	OUI
ESTL46	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé au titre du produit chaque année. Ce pourcentage concerne les expositions sous-jacentes qui autorisent un certain seuil de remboursement anticipé (c'est-à-dire 10 %) avant que les charges ne soient encourues.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL47	Date de fin d'interdiction du remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur permet le remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
ESTL48	Frais de remboursement anticipé	Montant encaissé auprès du débiteur en tant que commission/pénalité due pour l'exécution de remboursements anticipés en vertu des termes du contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Ce montant ne concerne pas les montants versés à titre de «frais de résiliation» pour compenser le non-paiement d'intérêts jusqu'à la date de paiement de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL49	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	Date à partir de laquelle le prêteur autorise un remboursement anticipé de l'exposition sous-jacente sans obligation de payer une pénalité.	OUI	OUI
ESTL50	Date du dernier remboursement anticipé	Dernière date à laquelle un versement au capital non prévu à l'échéancier est reçu.	OUI	OUI
ESTL51	Remboursements anticipés cumulés	Total des remboursements anticipés encaissés à la date d'arrêté des données (définis en tant que versements au capital non prévus à l'échéancier) depuis la date d'initiation de l'exposition sous-jacente. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL52	Date du dernier arriéré	Date du dernier arriéré du débiteur.	OUI	OUI
ESTL53	Encours des arriérés	Encours actuel des arriérés, défini en tant que: total des versements arrivés à échéance PLUS tout montant capitalisé PLUS toute commission appliquée au compte MOINS total des versements reçus à ce jour S'il n'y a pas d'arriéré, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL54	Nombre de jours d'arriérés	Nombre de jours depuis que l'exposition sous-jacente présente des arriérés (intérêts ou principal et, en cas de différence, le nombre le plus élevé entre les deux) à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL55	Situation du compte	<p>Situation actuelle de l'exposition sous-jacente ayant été titrisée:</p> <p>Performante (PERF)</p> <p>Restructurée – aucun arriéré (RNAR)</p> <p>Restructurée – arriérés (RARR)</p> <p>En défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (DFLT)</p> <p>Ne fait pas l'objet d'un défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 mais classée comme faisant l'objet d'un défaut en raison d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (NDFT)</p> <p>En défaut tant au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 qu'au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DTCR)</p> <p>En défaut uniquement au sens d'une autre définition du défaut à laquelle elle répond (DADB)</p> <p>Arriérés (ARRE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – violation de déclarations et de garanties (REBR)</p> <p>Rachetée par le vendeur – en défaut (REDF)</p> <p>Rachetée par le vendeur – restructurée (RERE)</p> <p>Rachetée par le vendeur – recouvrement spécial (RESS)</p> <p>Rachetée par le vendeur – autre raison (REOT)</p> <p>Remboursée (RDMD)</p> <p>Autre (OTHR)</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaires de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p>	NON	NON
ESTL56	Raison du défaut ou de la saisie	<p>Si l'exposition sous-jacente est en défaut au sens de l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013, sélectionner la raison appropriée:</p> <p>En défaut car le débiteur ne pourra probablement pas payer, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPXX)</p> <p>En défaut car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (PDXX)</p> <p>En défaut à la fois car il est estimé que le débiteur ne pourra probablement pas payer et car l'arriéré est supérieur à 90/180 jours, conformément à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013 (UPPD)</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL57	Montant du défaut	Montant brut total du défaut avant imputation du produit de la vente et des recouvrements. S'il n'y a pas de défaut, entrer 0. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL58	Date du défaut	Date du défaut.	OUI	OUI
ESTL59	Pertes allouées	Pertes allouées à ce jour, nettes de commissions, d'intérêts courus, etc., après imputation du produit de la vente (à l'exclusion de la pénalité de remboursement anticipé si subordonnée aux recouvrements du capital). Indiquer toute plus-value par un nombre négatif. Doit refléter la situation la plus récente à la date d'arrêt des données, à savoir au moment de l'encaissement des recouvrements et au cours du processus de rééchelonnement. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL60	Recouvrements cumulés	Total des recouvrements (quelle que soit leur source) sur la dette (en défaut/radiée/etc.), nets de coûts. Inclure toutes les sources de recouvrement ici et non uniquement le produit de la cession de toute sûreté. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
ESTL61	Nom de l'initiateur	Indiquer la dénomination sociale complète de l'initiateur de l'exposition sous-jacente. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
ESTL62	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
ESTL63	Pays d'établissement de l'initiateur	Pays dans lequel est établi l'initiateur de l'exposition sous-jacente.	NON	NON
ESTL64	Nom du prêteur initial	Indiquer la dénomination sociale complète du prêteur initial. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTL65	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du prêteur initial. S'il n'existe aucun identifiant d'entité juridique, entrer ND5.	OUI	OUI
ESTL66	Pays d'établissement du prêteur initial	Pays dans lequel est établi le prêteur initial.	OUI	OUI

Informations au niveau de la sûreté

ESTC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ ESTL1.	NON	NON
ESTC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ ESTL3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTC3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté ou à la garantie. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTC4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ ESTC3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ ESTC3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
ESTC5	Région géographique – Sûreté	Région géographique (nomenclature NUTS3) dans laquelle est située la sûreté. Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
ESTC6	Type de sûreté	Type de sûreté: Sûreté réelle (collatéral) (COLL) Garantie adossée à une sûreté réelle (GCOL) Garantie non adossée à une sûreté réelle (GNCO) Autre (OTHR)	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTC7	Type de charge	<p>Type de charge constituée sur la sûreté réelle. En cas de garantie, ce champ renvoie à tout type de sûreté sur toute sûreté réelle couvrant cette garantie. «Aucune charge, mais une procuration irrévocable ou une procuration similaire» désigne la situation dans laquelle l'initiateur ou le prêteur initial, le cas échéant, est irrévocablement et inconditionnellement autorisé à créer unilatéralement une charge sur la sûreté réelle à tout moment dans l'avenir, sans qu'aucune autre approbation ne soit nécessaire de la part du débiteur ou du garant:</p> <p>Charge fixe (FXCH)</p> <p>Charge variable (FLCH)</p> <p>Aucune charge (NOCG)</p> <p>Aucune charge mais une procuration irrévocable ou une procuration similaire (ATRN)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	OUI
ESTC8	Privilège	Position de privilège la plus élevée détenue par l'initiateur en ce qui concerne la sûreté.	OUI	OUI
ESTC9	Type de sûreté	<p>Principal type d'actif (en termes de valeur) garantissant la dette. Dans le cas de garanties adossées à des sûretés physiques ou financières, se baser sur toutes les sûretés sur lesquelles la garantie est adossée.</p> <p>Automobile (CARX)</p> <p>Véhicule industriel (INDV)</p> <p>Camion commercial (CMTR)</p> <p>Véhicule ferroviaire (RALV)</p> <p>Véhicule nautique commercial (NACM)</p> <p>Véhicule nautique de loisir (NALV)</p> <p>Avion (AERO)</p> <p>Machine-outil (MCHT)</p> <p>Équipement industriel (INDE)</p> <p>Équipement de bureau (OFEQ)</p> <p>Équipement informatique (ITEQ)</p> <p>Équipement médical (MDEQ)</p> <p>Équipement lié à l'énergie (ENEQ)</p> <p>Bâtiment commercial (CBLD)</p> <p>Bâtiment résidentiel (RBLD)</p> <p>Bâtiment industriel (IBLD)</p> <p>Autre véhicule (OTHV)</p> <p>Autre équipement (OTHE)</p>	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Autre bien immobilier (OTRE)</p> <p>Autres produits ou stocks (OTGI)</p> <p>Titres (SECU)</p> <p>Garantie (GUAR)</p> <p>Autre actif financier (OTFA)</p> <p>Catégories mixtes correspondant à une sûreté constituée sur tous les actifs du débiteur (MIXD)</p> <p>Autre (OTHR)</p>		
ESTC10	Montant de la valorisation actuelle	<p>Valorisation la plus récente de la sûreté. Lorsqu'une garantie est adossée à une sûreté physique ou financière, examiner la garantie afin d'identifier la sûreté qui la couvre.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
ESTC11	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	<p>Méthode de calcul de la valeur la plus récente de la sûreté, comme indiqué dans le champ ESTC10:</p> <p>Évaluation complète (FAPR)</p> <p>Inspection rapide (DRVB)</p> <p>Modèle de valorisation automatisé (AUVM)</p> <p>Indexée (IDXN)</p> <p>Par ordinateur (DKTP)</p> <p>Mandataire ou agent immobilier (MAEA)</p> <p>Prix d'achat (PPRI)</p> <p>Décote (HCUT)</p> <p>Évaluation au prix du marché (MTTM)</p> <p>Évaluation du débiteur (OBLV)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	OUI	OUI
ESTC12	Date de valorisation actuelle	Date de la valorisation la plus récente de la sûreté, comme indiqué dans le champ ESTC10.	OUI	OUI
ESTC13	Ratio actuel prêt/valeur	Ratio prêt/valeur actuel (LTV). Pour les prêts avec privilèges de second rang, il s'agit du ratio prêt/valeur combiné ou total. Lorsque l'encours du prêt est négatif, entrer 0.	OUI	OUI
ESTC14	Montant de la valorisation initiale	<p>Valorisation initiale de la sûreté à la date d'initiation de l'exposition sous-jacente.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
ESTC15	Méthode suivie pour la valorisation initiale	Méthode de calcul de la valeur de la sûreté indiquée dans le champ ESTC14 au moment de l'initiation de l'exposition sous-jacente: Évaluation complète (FAPR) Inspection rapide (DRVB) Modèle de valorisation automatisé (AUVM) Indexée (IDX) Par ordinateur (DKTP) Mandataire ou agent immobilier (MAEA) Prix d'achat (PPRI) Décote (HCUT) Évaluation au prix du marché (MTM) Évaluation du débiteur (OBLV) Autre (OTHR)	OUI	OUI
ESTC16	Date de la valorisation initiale	Date de la valorisation initiale de la sûreté physique ou financière, comme indiqué dans le champ ESTC14.	OUI	OUI
ESTC17	Ratio initial prêt/valeur	Ratio prêt/valeur (LTV) initial du prêt souscrit par l'initiateur. Pour les prêts avec privilèges de second rang, il s'agit du ratio prêt/valeur combiné ou total.	OUI	OUI
ESTC18	Date de la vente	Date de vente de la sûreté.	NON	OUI
ESTC19	Prix de vente	Prix réalisé sur la vente de la sûreté en cas de saisie. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
ESTC20	Monnaie de la sûreté	Il s'agit de la devise dans laquelle le montant de la valorisation indiquée dans le champ ESTC10 est libellé.	NON	OUI



ANNEXE X

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – COMPLÉMENT RELATIF AUX EXPOSITIONS NON PERFORMANTES

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
---------------	--------------	--------------------	-------------------	---------------

Informations sur les expositions sous-jacentes

NPEL1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224. Cette entrée doit correspondre au champ «Identifiant unique» du modèle d'accompagnement pour les expositions sous-jacentes complété pour cette exposition sous-jacente spécifique.	NON	NON
NPEL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique. Cette entrée doit correspondre au champ «Identifiant initial de l'exposition sous-jacente» du modèle d'accompagnement pour les expositions sous-jacentes (annexes II à IX du présent règlement) complété pour cette exposition sous-jacente spécifique.	NON	NON
NPEL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ NPEL2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici [ce nouvel identifiant doit correspondre au champ «Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente» du modèle d'accompagnement pour les expositions sous-jacentes (annexes II à IX du présent règlement) complété pour cette exposition sous-jacente spécifique]. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ NPEL2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
NPEL4	Identifiant initial du débiteur	Identifiant initial unique du débiteur. L'identifiant doit être différent de tout numéro d'identification externe afin d'assurer l'anonymat du débiteur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique. Cette entrée doit correspondre au champ «Identifiant initial du débiteur» du modèle d'accompagnement pour les expositions sous-jacentes (annexe II à IX du présent règlement) complété pour cette exposition sous-jacente spécifique.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEL5	Nouvel identifiant du débiteur	Si l'identifiant initial dans le champ NPEL4 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici [et ce nouvel identifiant doit correspondre au champ «Nouvel identifiant du débiteur» dans le modèle d'accompagnement pour les expositions sous-jacentes (annexes II à IX du présent règlement) complété pour cette exposition sous-jacente spécifique]. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ NPEL4. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
NPEL6	Date d'arrêté des données	Date d'arrêté des données pour la présente communication de données.	NON	NON
NPEL7	Sous administration judiciaire	Indicateur: le débiteur est-il sous administration judiciaire?	OUI	OUI
NPEL8	Date du dernier contact	Date du dernier contact direct avec le débiteur.	OUI	OUI
NPEL9	Décédé	Indicateur: le débiteur est-il décédé?	OUI	OUI
NPEL10	Statut juridique	Type de statut juridique du débiteur: Société cotée – entreprise dont les actions sont cotées et négociées sur un marché boursier (LCRP) Société non cotée – entreprise dont les actions ne sont pas cotées ni négociées sur un marché boursier, toutefois une société non cotée peut avoir un nombre illimité d'actionnaires afin de mobiliser des capitaux pour toutes entreprise commerciale (UCRP) Fonds coté – fonds dont les actions sont cotées et négociées sur un marché boursier (LFND) Fonds non coté – fonds dont les actions ne sont pas cotées ni négociées sur un marché boursier (UFND) Partenariat – lorsque le sponsor constitue un groupe de personnes physiques qui forment un partenariat juridique dans lequel les bénéfices et les responsabilités sont partagés (PSHP) Particulier (INDV)	OUI	OUI
NPEL11	Type de procédure judiciaire	Type de procédure d'insolvabilité dont le débiteur fait actuellement l'objet: Procédure de restructuration des entreprises, inclut également les fonds (CPRR) Procédure d'insolvabilité des entreprises, inclut également les fonds (CPRR)	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Procédure de compromis sur la dette des débiteurs (particuliers) (PRCM) Procédure d'insolvabilité des débiteurs (particuliers) (PRIP) Procédure de restructuration des partenariats (PRTR) Procédure d'insolvabilité des partenariats (PRIS) Autre (OTHR)		
NPEL12	Nom de la procédure judiciaire	Nom de la procédure judiciaire qui fournit une indication sur l'état d'avancement de la procédure concernée, selon le pays dans lequel est situé le débiteur.	OUI	OUI
NPEL13	Procédures juridiques déjà menées à bien	Description des procédures juridiques déjà menées à bien à l'endroit du débiteur.	OUI	OUI
NPEL14	Date d'ouverture de la procédure juridique en cours	Date depuis laquelle le débiteur fait l'objet de la procédure juridique en cours.	OUI	OUI
NPEL15	Date de nomination de l'administrateur de l'insolvabilité	Date à laquelle l'administrateur de l'insolvabilité a été nommé.	OUI	OUI
NPEL16	Nombre de jugements en attente d'exécution	Nombre de jugements en attente d'exécution à l'encontre du débiteur.	OUI	OUI
NPEL17	Nombre de jugements exécutés	Nombre de jugements exécutés à l'encontre du débiteur.	OUI	OUI
NPEL18	Date d'envoi d'une demande de paiement par un tiers	Date à laquelle les avocats agissant au nom de l'établissement ont envoyé une demande de paiement.	OUI	OUI
NPEL19	Date d'envoi de la lettre de réserve de droits	Date à laquelle l'établissement a envoyé la lettre de réserve de droits.	OUI	OUI
NPEL20	Juridiction saisie	Emplacement du tribunal où le dossier est instruit.	OUI	OUI
NPEL21	Date d'obtention de l'ordonnance de saisie	Date à laquelle l'ordonnance de saisie est rendue par le tribunal.	OUI	OUI
NPEL22	Commentaires sur d'éventuelles autres procédures judiciaires	Commentaires/détails supplémentaires si d'autres procédures judiciaires éventuellement en cours.	OUI	OUI
NPEL23	Droit applicable	Juridiction régissant le contrat relatif à l'exposition sous-jacente. Elle ne correspond pas nécessairement au pays d'initiation de l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
NPEL24	Description des modalités spécifiques de remboursement	Description du profil spécifique du remboursement lorsque «Autre» est sélectionné dans le champ «Type d'amortissement».	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEL25	Date de début de la période de versement des seuls intérêts	Date à laquelle débute la période actuelle de remboursement des seuls intérêts.	OUI	OUI
NPEL26	Date de fin de la période de versement des seuls intérêts	Date à laquelle s'achève la période de remboursement des seuls intérêts.	OUI	OUI
NPEL27	Date de début de la période actuelle d'intérêts fixes	Date à laquelle débute la période actuelle d'intérêts fixes.	OUI	OUI
NPEL28	Date de fin de la période actuelle d'intérêts fixes	Date à laquelle débute la période actuelle d'intérêts fixes.	OUI	OUI
NPEL29	Niveau actuel du taux d'intérêt révisable	Niveau actuel du taux d'intérêt révisable conformément au contrat relatif à l'exposition sous-jacente.	OUI	OUI
NPEL30	Date de paiement la plus récente	Date à laquelle a été effectué le dernier paiement.	OUI	OUI
NPEL31	Portion syndiquée	Pourcentage de la portion détenue par l'établissement si «Oui» est sélectionné dans le champ «Syndiqué» de l'annexe applicable pour l'exposition non performante.	OUI	OUI
NPEL32	Déclenchement de la procédure MARP	Date à laquelle l'exposition sous-jacente a acquis le statut MARP actuel.	OUI	OUI
NPEL33	Statut MARP	Statut du processus de règlement des arriérés hypothécaires: Ne fait pas l'objet de MARP (NMRP) Sortie de MARP (EMRP) Disposition 23, 31 jours d'arriérés (MP23) Disposition 24, difficultés financières (MP24) Disposition 28, avertissement pour non-coopération (MP28) Disposition 29, non-coopération (MP29) Disposition 42, offre de restructuration (MP42) Disposition 45, restructuration refusée par le vendeur (MP45) Disposition 47, restructuration refusée par l'emprunteur (MP47) Auto-rétablissement (MPSC) Autre accord de remboursement (MPAR) Autre (OTHR)	OUI	OUI
NPEL34	Niveau des encaissements externes	Indicateur: les encaissements externes ont-ils été préparés au niveau du débiteur ou au niveau de l'exposition sous-jacente?	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEL35	Plan de remboursement	Indicateur: un plan de remboursement a-t-il été arrêté avec l'agence d'encaissement externe?	OUI	OUI
NPEL36	Niveau de renégociation	Indicateur: la renégociation a-t-elle été préparée au niveau du débiteur ou au niveau de l'exposition sous-jacente?	OUI	OUI
NPEL37	Date de la première renégociation	Date à laquelle la première renégociation a eu lieu.	OUI	OUI
NPEL38	Nombre de renégociations antérieures	Nombre de renégociations qui ont eu lieu dans le passé.	OUI	OUI
NPEL39	Annulation du principal	Montant du principal ayant été annulé dans le cadre de la renégociation actuelle, y compris l'annulation du principal approuvée par des agences d'encaissement externe. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEL40	Date d'annulation du principal	Date à laquelle a eu lieu l'annulation du principal.	OUI	OUI
NPEL41	Date de fin de validité de la renégociation	Date à laquelle prend fin l'accord de renégociation actuel.	OUI	OUI
NPEL42	Montant des remboursements après renégociation	Montant des remboursements périodiques convenu entre l'établissement et le débiteur en vertu des conditions de la renégociation actuelle. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

Informations au niveau de la sûreté

NPEC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ NPEL1.	NON	NON
NPEC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ NPEL3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
NPEC3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté ou à la garantie. Lorsque le type de l'exposition sous-jacente nécessite de remplir les annexes II, III, IV ou IX, ce champ doit correspondre au champ «Identifiant initial de la sûreté» du modèle concerné complété pour cette sûreté spécifique (c'est-à-dire, ce champ doit correspondre à l'identifiant entré dans les champs RREC3, CREC3, CRPC3, et ESTC3, le cas échéant). L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEC4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ NPEC3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Lorsque le type de l'exposition sous-jacente nécessite de remplir les annexes II, III, IV ou IX, ce nouvel identifiant doit correspondre au champ «Nouvel identifiant de la garantie» du modèle concerné complété pour cette garantie spécifique (c'est-à-dire, ce champ doit correspondre à l'identifiant entré dans les champs RREC4, CREC4, CRPC4, et ESTC4, le cas échéant). Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ NPEC3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
NPEC5	TVA due	Montant de TVA dû à la cession de l'unité.	OUI	OUI
NPEC6	Pourcentage atteint	Pourcentage de progression atteint depuis le début de la construction.	OUI	OUI
NPEC7	Statut de la procédure d'exécution	Statut de la procédure d'exécution dont fait actuellement l'objet la sûreté à la date d'arrêté, par exemple si elle est sous administration judiciaire.	OUI	OUI
NPEC8	Statut de la procédure d'exécution du point de vue de tiers	D'autres créanciers garantis ont-ils pris des mesures pour exécuter la sûreté sur l'actif?	OUI	OUI
NPEC9	Montant d'hypothèque attribué	Montant total de l'hypothèque attribuée au bien en garantie. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC10	Expositions sous-jacentes de rang supérieur	Nombre d'expositions sous-jacentes de rang/privilège supérieur garanties par la sûreté qui ne sont pas détenues par l'établissement et ne font pas partie du portefeuille. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC11	Description des modalités d'exécution	Commentaires sur ou description de la phase d'exécution.	OUI	OUI
NPEC12	Montant de l'évaluation judiciaire	Montant de l'évaluation judiciaire du bien/de la sûreté. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC13	Date de l'évaluation judiciaire	Date à laquelle a eu lieu l'évaluation judiciaire	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEC14	Prix sur le marché	Prix du bien/de la sûreté auquel il/elle est sur le marché. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC15	Offre de prix	Prix maximal offert par des acheteurs potentiels. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC16	Date de la préparation du bien pour la vente	Date de la préparation du bien/de la sûreté pour la vente.	OUI	OUI
NPEC17	Date de mise sur le marché	Date de mise sur le marché de la sûreté, c'est-à-dire la date à laquelle la sûreté fait l'objet de publicité et est commercialisée en vue d'être vendue.	OUI	OUI
NPEC18	Date de l'offre sur le marché	Date de l'offre sur le marché.	OUI	OUI
NPEC19	Date fixée pour la vente	Date fixée pour la vente.	OUI	OUI
NPEC20	Date du contrat	Date du contrat.	OUI	OUI
NPEC21	Date de la première mise aux enchères	Date à laquelle a été effectuée la première mise aux enchères en vue de vendre le bien/la sûreté.	OUI	OUI
NPEC22	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la première mise aux enchères	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la première mise aux enchères, à savoir le prix minimal requis par le tribunal. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC23	Date de la mise aux enchères suivante	Date à laquelle a été effectuée la mise aux enchères suivante en vue de vendre le bien/la sûreté.	OUI	OUI
NPEC24	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la mise aux enchères suivante	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la mise aux enchères suivante, à savoir le prix minimal requis par le tribunal. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEC25	Date de la dernière mise aux enchères	Date à laquelle a été effectuée la dernière mise aux enchères en vue de vendre le bien/la sûreté.	OUI	OUI
NPEC26	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la dernière mise aux enchères	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la dernière mise aux enchères, à savoir le prix minimal requis par le tribunal. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
NPEC27	Nombre de mises aux enchères infructueuses	Nombre de mises aux enchères antérieures ayant échoué pour le bien/la sûreté.	OUI	OUI
Informations sur l'historique des encaissements				
NPEH1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ NPEL1.	NON	NON
NPEH2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique de l'exposition sous-jacente. Ce dernier doit correspondre à l'identifiant indiqué dans le champ NPEL3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
NPEH[3-38]	Solde légal restant dû au mois n	Historique du solde légal total restant dû dans les 36 mois précédant la date d'arrêt des données, dont chaque montant mensuel est indiqué dans un champ distinct. Commencer par le mois le plus récent dans le champ NPEH3 et terminer par le mois le plus ancien dans le champ NPEH38. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEH[39-74]	Historique des impayés au mois n	Historique du total des impayés dans les 36 mois précédant la date d'arrêt des données, dont chaque montant mensuel est indiqué dans un champ distinct. Commencer par le mois le plus récent dans le champ NPEH39 et terminer par le mois le plus ancien dans le champ NPEH74. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEH[75-110]	Historique des remboursements – Autres que la vente de sûretés – au mois n	Remboursements effectués par le débiteur dans les 36 mois précédant la date d'arrêt des données, à l'exclusion de la vente de sûretés et y compris les encaissements réalisés par des agences d'encaissement externe, et dont chaque montant mensuel est indiqué dans un champ distinct. Commencer par le mois le plus récent dans le champ NPEH75 et terminer par le mois le plus ancien dans le champ NPEH110. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
NPEH[111-146]	Historique des remboursements – Provenant de la vente de sûretés – au mois n	Remboursements provenant de la cession de sûretés dans les 36 mois précédant la date d'arrêt des données, dont chaque montant mensuel est indiqué dans un champ distinct. Commencer par le mois le plus récent dans le champ NPEH111 et terminer par le mois le plus ancien dans le champ NPEH146. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI



ANNEXE XI

INFORMATIONS SUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES – PAPIER COMMERCIAL ADOSSÉ À DES ACTIFS

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
---------------	--------------	--------------------	-------------------	---------------

Informations sur les expositions sous-jacentes

IVAL1	Identifiant unique – Programme ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante au programme ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
IVAL2	Identifiant unique – Opération ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante à cette opération ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
IVAL3	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	Identifiant unique du type de l'exposition sous-jacente. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVAL4	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	Si l'identifiant initial dans le champ IVAL3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ IVAL3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVAL5	Type d'exposition sous-jacente	Sélectionner le type d'exposition sous-jacente existant dans cette opération: Créance commerciale (TREC) Prêt ou crédit-bail automobile (ALOL) Prêt à la consommation (CONL) Crédit-bail d'équipement (EQPL) Crédit de financement de stocks de produits (FLRF) Prime d'assurance (INSU) Créance de carte de crédit (CCRR) Prêt hypothécaire résidentiel (RMRT) Prêt hypothécaire commercial (CMRT) Prêt aux petites et moyennes entreprises (SMEL) Prêt aux entreprises hors PME (NSML) Futur flux (FUTR) Fonds à effet de levier (LVRG) Titre Adossé à des Obligations (CBOB) Titre Adossé à des Prêts aux Entreprises (CLOB) Autre (OTHR)	NON	NON
IVAL6	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL7	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 1	Région géographique dans laquelle est situé le plus grand volume d'expositions sous-jacentes (par valeur actuelle des expositions à la date d'arrêt des données) de ce type, en termes d'emplacement de la sûreté (pour les expositions sous-jacentes garanties) ou du débiteur (pour les expositions sous-jacentes non garanties). Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
IVAL8	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 2	Région géographique dans laquelle est situé le deuxième plus grand volume d'expositions sous-jacentes (par valeur actuelle des expositions à la date d'arrêt des données) de ce type, en termes d'emplacement de la sûreté (pour les expositions sous-jacentes garanties) ou du débiteur (pour les expositions sous-jacentes non garanties). Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
IVAL9	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 3	Région géographique dans laquelle est situé le troisième plus grand volume d'expositions sous-jacentes principales (par valeur actuelle des expositions à la date d'arrêt des données) de ce type, en termes d'emplacement de la sûreté (pour les expositions sous-jacentes garanties) ou du débiteur (pour les expositions sous-jacentes non garanties). Si Eurostat n'a produit aucune nomenclature NUTS3 (par exemple, juridiction de pays tiers), entrer le code pays à deux chiffres au format {COUNTRYCODE_2} suivi de «ZZZ».	OUI	OUI
IVAL10	Classification des régions géographiques	Entrer l'année de la nomenclature NUTS3 utilisée pour les champs de région géographique, par exemple, 2013 pour la NUTS3 2013. La même nomenclature doit être utilisée de manière constante dans tous les champs de région géographique pour chaque exposition sous-jacente et pour toutes les expositions sous-jacentes dans la communication de données. Par exemple, utiliser la NUTS3 2006 dans certains champs de région géographique pour une exposition sous-jacente donnée et utiliser la NUTS3 2013 dans d'autres champs pour la même exposition n'est pas autorisé. De même, il n'est pas autorisé d'utiliser la NUTS3 2006 dans des champs de région géographique pour certaines expositions sous-jacentes et d'utiliser la NUTS3 2013 dans des champs de région géographique pour d'autres expositions sous-jacentes dans la même communication de données.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL11	Encours actuel du capital	Encours total du capital à la date d'arrêté des données pour ce type d'exposition. Ce montant inclut tous les montants assimilés au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL12	Nombre d'expositions sous-jacentes	Nombre d'expositions sous-jacentes de ce type qui sont titrisées.	OUI	NON
IVAL13	Expositions en EUR	Encours total du capital des expositions de ce type qui sont libellées en EUR à la date d'arrêté des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL14	Expositions en GBP	Encours total du capital des expositions de ce type qui sont libellées en GBP à la date d'arrêté des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL15	Expositions en USD	Encours total du capital des expositions de ce type qui sont libellées en USD à la date d'arrêté des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL16	Autres expositions	Encours total du capital des expositions de ce type qui sont libellées dans des devises autres que l'EUR, le GBP et l'USD à la date d'arrêté des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL17	Échéance résiduelle maximale	Échéance résiduelle la plus longue (en mois) de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI
IVAL18	Échéance résiduelle moyenne	Échéance résiduelle moyenne (en mois) de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données, pondérée par l'encours actuel à cette date.	OUI	OUI
IVAL19	Ratio actuel prêt/valeur	Ratio actuel prêt/valeur (LTV) en moyenne pondérée calculé à l'aide des encours actuels de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données. Pour les prêts avec privilèges de second rang, il s'agit du ratio prêt/valeur combiné ou total.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL20	Ratio de la dette au revenu	<p>Ratio de la dette au revenu du débiteur en moyenne pondérée calculé à l'aide des encours actuels de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêt des données. Dette définie en tant qu'encours total du capital de l'exposition sous-jacente existante à la date d'arrêt des données. Ce montant inclut tous les montants assimilés au capital dans la titrisation. Par exemple, si des commissions ont été ajoutées à l'encours de l'exposition sous-jacente et font partie du capital dans la titrisation, elles doivent être incluses. À l'exclusion des intérêts de retard ou des pénalités.</p> <p>Revenu défini en tant que revenu combiné, somme des revenus principal et (le cas échéant) secondaire.</p>	OUI	OUI
IVAL21	Type d'amortissement	<p>Encours total du capital des expositions de ce type dont l'amortissement est in fine, ballon, un arrangement autre qu'un amortissement français ou allemand, ou un échéancier d'amortissement fixe. Aux fins de ce champ:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «amortissement français» est défini en tant qu'amortissement selon lequel le montant total (principal et intérêts) remboursé à chaque tranche est identique; — «amortissement allemand» est défini en tant qu'amortissement selon lequel la première tranche concerne uniquement les intérêts et les tranches restantes sont constantes, y compris l'amortissement du capital et les intérêts; — «échéancier d'amortissement fixe» est défini en tant qu'amortissement selon lequel le montant du capital remboursé à chaque tranche est identique; — «amortissement in fine» est défini en tant qu'amortissement selon lequel le montant total du capital est remboursé à la dernière tranche; — «amortissement ballon» est défini en tant qu'amortissement consistant en des remboursements partiels du capital suivis d'un montant final de capital plus important; et — «autre amortissement» est défini en tant qu'autre type d'amortissement ne relevant d'aucune des catégories énumérées ci-dessus. <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL22	Périodicité prévue pour le remboursement du principal supérieure à un mois	<p>Encours total du capital des expositions de ce type dont la périodicité des versements du capital dû, à savoir la période entre chaque versement, est supérieure à un mois (par exemple, trimestrielle, semestrielle, annuelle, in fine, à coupon zéro, autre).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL23	Périodicité prévue pour le paiement d'intérêts supérieure à un mois	Encours total du capital des expositions de ce type dont la périodicité du paiement des intérêts dus, à savoir la période entre chaque paiement, est supérieure à un mois (par exemple, trimestrielle, semestrielle, annuelle, in fine, à coupon zéro, autre). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL24	Créances à taux variables	Encours total du capital des expositions de ce type à la date d'arrêt des données dont le taux d'intérêt s'entend généralement comme «variable». «Variable» désigne un taux indexé sur l'un des indices suivants: LIBOR (toute devise et échéance), EURIBOR (toute devise et échéance), tout taux de base d'une banque centrale (BoE, ECB, etc.), le taux variable standard de l'initiateur ou tout indice similaire. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL25	Montant financé	Montant des expositions sous-jacentes achetées auprès de l'initiateur dans le cadre de cette opération qui a été financé par un papier commercial, entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de la présente communication de données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL26	Dilutions	Total des réductions sur les expositions sous-jacentes au titre du capital au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL27	Expositions rachetées	Encours total du capital des expositions de ce type ayant été rachetées (c'est-à-dire, retirées du panier des expositions sous-jacentes en étant rachetées) par l'initiateur/le sponsor entre la dernière date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données actuelle. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL28	Expositions en défaut, ou expositions à un débiteur en difficulté, au moment de la titrisation	Conformément à l'article 24, paragraphe 9, du règlement (UE) 2017/2402, entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui, au moment de la titrisation, étaient soit des expositions en défaut, soit des expositions à un débiteur ou à un garant en difficulté au sens de ce même article. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL29	Expositions en défaut	Encours total du capital des expositions de ce type en défaut à la date d'arrêt des données, selon la définition du défaut précisée dans la documentation de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL30	Expositions en défaut CRR	Encours total du capital des expositions de ce type en défaut à la date d'arrêt des données, selon la définition du défaut précisée à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL31	Montants bruts radiés au cours de la période	Valeur faciale des radiations brutes (c'est-à-dire avant recouvrements) pour la période. La radiation selon la définition de la titrisation ou, à défaut, suivant l'usage normal du prêteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAL32	Arriérés 1-29 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 1 à 29 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêt des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêt des données.	OUI	OUI
IVAL33	Arriérés 30-59 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 30 à 59 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêt des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêt des données.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL34	Arriérés 60-89 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 60 à 89 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêté des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêté des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI
IVAL35	Arriérés 90-119 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 90 à 119 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêté des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêté des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI
IVAL36	Arriérés 120-149 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 120 à 149 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêté des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêté des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI
IVAL37	Arriérés 150-179 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 150 à 179 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêté des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêté des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI
IVAL38	Arriérés 180 jours ou +	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 180 jours ou plus à la date d'arrêté des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêté des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêté des données.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL39	Expositions restructurées	<p>Entrer la proportion d'expositions de ce type qui ont déjà été restructurées par l'initiateur/le sponsor, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Calculer la proportion en divisant l'encours actuel total de ces expositions par l'encours actuel total des expositions de ce type, à la date d'arrêt des données.</p>	OUI	OUI
IVAL40	Expositions restructurées (0 à 1 an avant transfert)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont été restructurées par l'initiateur/le sponsor à tout moment au moins un an et moins d'un an avant la date de transfert ou de cession à la SSPE, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL41	Expositions restructurées (1 à 3 ans avant transfert)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont été restructurées par l'initiateur/le sponsor à tout moment au moins un an et moins de trois ans avant la date de transfert ou de cession à la SSPE, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL42	Expositions restructurées (plus de 3 ans avant transfert)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont été restructurées par l'initiateur/le sponsor à tout moment au moins trois ans avant la date de transfert ou de cession à la SSPE, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL43	Expositions restructurées (taux d'intérêt)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type dont le taux d'intérêt a été restructuré par l'initiateur/le sponsor, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration du taux d'intérêt» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente concernant le taux d'intérêt à la suite d'une renégociation, notamment une modification de la base du taux d'intérêt ou des marges sur ce dernier, des commissions, des pénalités et/ou toute autre mesure de restructuration du taux d'intérêt généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL44	Expositions restructurées (échancier de remboursement)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type dont l'échéancier de remboursement a été restructuré par l'initiateur/le sponsor, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration de l'échéancier de remboursement» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente concernant l'échéancier de remboursement à la suite d'une renégociation, notamment une dispense temporaire de remboursement, une modification du calendrier de remboursement et/ou toute autre mesure de restructuration de l'échéancier de remboursement généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL45	Expositions restructurées (structure des échéances)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type dont le profil des échéances a été restructuré par l'initiateur/le sponsor, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration de la structure des échéances» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente concernant les échéances à la suite d'une renégociation, notamment une prolongation des échéances et/ou toute autre mesure de restructuration des échéances généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL46	Expositions restructurées (0 à 1 an avant transfert et pas de nouveaux arriérés)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont été restructurées par l'initiateur/le sponsor de 0 à 1 an avant la date de transfert ou de cession à la SSPE ET qui n'ont jamais présenté d'arriérés (versement du principal ou des intérêts) depuis la date de restructuration, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL47	Expositions restructurées (pas de nouveaux arriérés)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont déjà été restructurées par l'initiateur/le sponsor ET qui n'ont jamais présenté d'arriérés (versement du principal ou des intérêts) depuis la date de restructuration, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAL48	Expositions restructurées (nouveaux arriérés)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont déjà été restructurées par l'initiateur/le sponsor ET qui ont déjà présenté des arriérés (versement du principal ou des intérêts) depuis la date de restructuration, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>«Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVAL49	Expositions restructurées (autre)	<p>Entrer l'encours total du capital des expositions de ce type qui ont été restructurées par l'initiateur/le sponsor, à l'exclusion des restructurations déjà indiquées dans les champs IVAL43, IVAL44, et IVAL45, tel que visé à l'article 24, paragraphe 9, point a), du règlement (UE) 2017/2402.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI

▼ B

ANNEXE XII

▼ C1INFORMATIONS DEVANT FIGURER DANS LES RAPPORTS DESTINÉS AUX INVESTISSEURS —
TITRISATION AUTRE QU'ABCP▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur la titrisation				
IVSS1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
IVSS2	Date d'arrêté des données	Date d'arrêté des données pour la présente communication de données. Cette date doit correspondre à la date d'arrêté des données figurant dans les modèles applicables pour les expositions sous-jacentes ayant été soumis.	NON	NON
IVSS3	Nom de la titrisation	Entrer le nom de la titrisation.	NON	NON
IVSS4	Nom de l'entité déclarante	Dénomination sociale complète de l'entité visée à l'article 7, paragraphe 2, du règlement (UE) 2017/2402; cette dénomination doit correspondre à la dénomination entrée pour cette entité dans le champ SESP3 dans la section relative aux informations sur les contreparties. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
IVSS5	Personne de contact de l'entité déclarante	Nom et prénom de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVSS6	Coordonnées téléphoniques de l'entité déclarante	Numéro(s) de téléphone direct(s) de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVSS7	Coordonnées électroniques de l'entité déclarante	Adresse(s) électronique(s) directe(s) de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVSS8	Méthode de rétention du risque	Méthode utilisée pour se conformer aux exigences en matière de rétention du risque dans l'Union européenne [par exemple, article 6 du règlement (UE) 2017/2042 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013]; Tranche verticale, à savoir article 6, paragraphe 3, point a) (VSLC)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		<p>Part du vendeur, à savoir article 6, paragraphe 3, point b) (SLLS)</p> <p>Expositions choisies d'une manière aléatoire maintenues au bilan, à savoir article 6, paragraphe 3, point c) (RSEX)</p> <p>Tranche de première perte, à savoir article 6, paragraphe 3, point d) (FLTR)</p> <p>Exposition de première perte pour chaque actif, à savoir article 6, paragraphe 3, point e) (FLEX)</p> <p>Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM)</p> <p>Autre (OTHR)</p>		
IVSS9	Entité conservant le risque	<p>Entité conservant l'intérêt économique net significatif, tel que visé à l'article 6 du règlement (UE) 2017/2402 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013:</p> <p>Initiateur (ORIG)</p> <p>Sponsor (SPON)</p> <p>Prêteur initial (OLND)</p> <p>Vendeur (SELL)</p> <p>Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	NON
IVSS10	Type d'exposition sous-jacente	<p>Entrer le type des expositions sous-jacentes de la titrisation. S'il y a plusieurs types de la liste ci-dessous, entrer «Mixte» (à l'exception des titrisations dont les expositions sous-jacentes consistent exclusivement en une combinaison de prêts à la consommation et de prêts ou crédits-bails automobiles; pour ces titrisations, la valeur correspondant à «Prêts à la consommation» doit être entrée):</p> <p>Prêt ou contrat de location automobile (ALOL)</p> <p>Prêt à la consommation (CONL)</p> <p>Prêt hypothécaire commerciale (CMRT)</p> <p>Créance de carte de crédit (CCRR)</p> <p>Contrat de location (LEAS)</p> <p>Prêt hypothécaire (RMRT)</p> <p>Mixte (MIXD)</p> <p>Prêt aux petites et moyennes entreprises (SMEL)</p> <p>Prêt aux entreprises hors PME (NSML)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	NON
IVSS11	Méthode de transfert du risque	<p>Conformément à l'article 242, paragraphes 13 et 14, du règlement (UE) n° 575/2013, la méthode de transfert du risque de la titrisation est «classique» (à savoir, «cession parfaite»).</p>	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS12	Mesures/ratios de déclenchement	Un événement déclencheur lié aux expositions sous-jacentes est-il survenu? Cela inclut un retard, une dilution, un défaut, un arrêt de substitution, un arrêt de renouvellement ou un événement similaire lié aux expositions sous-jacentes affectant la titrisation, à la date d'arrêt des données. Cela inclut également un éventuel solde débiteur sur un registre des impayés en principal ou la défaillance éventuelle d'un actif.	NON	NON
IVSS13	Date d'expiration de la période de renouvellement/de démarrage (ramp-up)	Entrer la date à laquelle est prévue la fin de la période de renouvellement ou de démarrage. Entrer la date d'échéance de la titrisation en cas de période de renouvellement sans date de fin prévue.	NON	OUI
IVSS14	Recouvrements de principal au cours de la période	Recouvrements de principal brut reçus au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
IVSS15	Recouvrements d'intérêts au cours de la période	Recouvrements d'intérêts bruts reçus au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
IVSS16	Encaissements de principal au cours de la période	Encaissements considérés comme du capital au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
IVSS17	Encaissements d'intérêts au cours de la période	Encaissements considérés comme des recettes au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
IVSS18	Prélèvements sur la facilité de trésorerie	Si la titrisation prévoit une facilité de trésorerie, confirmer s'il y a eu ou non un prélèvement sur la facilité de trésorerie au cours de la période se terminant à la date du dernier versement des intérêts.	NON	OUI
IVSS19	Marge excédentaire de la titrisation	Montant des fonds restant après l'application de toutes les étapes actuellement applicables de la cascade, communément désigné en tant que «marge excédentaire». Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
IVSS20	Mécanisme de rétention de la marge excédentaire	Marge excédentaire actuellement retenue dans la titrisation (par exemple, cumulée dans un compte de réserve séparé).	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS21	Surcollatéralisation actuelle	Surcollatéralisation actuelle de la titrisation, calculée en tant que rapport entre (la somme de l'encours du capital de toutes les expositions sous-jacentes, à l'exclusion des expositions sous-jacentes classées en défaut, à la date d'arrêt des données) et (la somme de l'encours du capital de toutes les tranches/obligations à la date d'arrêt des données).	NON	NON
IVSS22	Taux constant annualisé de remboursement anticipé	Taux constant annualité de remboursement anticipé (CPR) des expositions sous-jacentes calculé à partir du CPR périodique le plus récent. Le CPR périodique est égal au [(montant total du principal non prévu à l'échéancier et reçu à la fin de la période d'encaissement la plus récente)/(l'encours total du principal au début de la période d'encaissement)]. Le CPR périodique est ensuite annualisé comme suit: $100 * [1 - (1 - \text{CPR périodique})^{\text{nombre de périodes d'encaissement dans une année}}]$ «CPR périodique» désigne le CPR au cours de la période d'encaissement, c'est-à-dire pour une titrisation incluant des obligations à coupons trimestriels, il s'agit habituellement de la précédente période de trois mois.	NON	NON
IVSS23	Dilutions	Total des réductions sur le capital des expositions au cours de la période. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
IVSS24	Montants bruts radiés au cours de la période	Montant total des radiations brutes (c'est-à-dire avant recouvrements) pour la période. La radiation selon la définition de la titrisation ou, à défaut, suivant l'usage normal du prêteur. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
IVSS25	Expositions rachetées	Encours total en principal des expositions sous-jacentes ayant été rachetées par l'initiateur/le sponsor entre la dernière date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données actuelle. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS26	Expositions restructurées	<p>Encours total en principal des expositions sous-jacentes ayant été restructurées par l'initiateur/le sponsor entre la dernière date d'arrêté des données et la date d'arrêté des données actuelle. «Restructuration» désigne toute modification des conditions du contrat relatif à l'exposition sous-jacente à la suite d'une renégociation, y compris une dispense temporaire de remboursement, une capitalisation des arriérés, une modification de la base ou de la marge du taux d'intérêt, des commissions, des pénalités, de l'échéance et/ou toute autre mesure de restructuration généralement admise à la suite d'une renégociation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	NON
IVSS27	Taux constant annualisé de défaut	<p>Taux constant annualisé de défaut (CDR) des expositions sous-jacentes calculé à partir du CDR périodique. Le CDR périodique est égal à [(l'encours total actuel des expositions sous-jacentes classées en défaut au cours de la période)/(l'encours total actuel des expositions sous-jacentes sur lesquelles il n'y a pas eu de défaut au début de la période)]. Cette valeur est ensuite annualisée comme suit:</p> $100 * [1 - [(1 - \text{CDR périodique})^{\text{nombre de périodes d'encassement dans une année}}]]$ <p>«CDR périodique» désigne le CDR au cours de la période d'encassement, c'est-à-dire pour une titrisation incluant des obligations à coupons trimestriels, il s'agit habituellement de la précédente période de trois mois.</p>	NON	NON
IVSS28	Expositions en défaut	<p>Encours total en principal à la date d'arrêté des données des expositions en défaut à cette date, selon la définition du défaut précisée dans la documentation de la titrisation.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	NON
IVSS29	Expositions en défaut CRR	<p>Encours total en principal à la date d'arrêté des données des expositions en défaut à cette date, selon la définition du défaut précisée à l'article 178 du règlement (UE) n° 575/2013.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	OUI	OUI
IVSS30	Méthode de pondération du risque	<p>Indiquer la méthode de pondération du risque utilisée par l'initiateur pour produire la pondération de risque attachée aux expositions sous-jacentes, conformément au règlement (UE) n° 575/2013:</p> <p>Approche standard (STND)</p> <p>Approche fondée sur les notations internes – simple (FIRB)</p> <p>Approche fondée sur les notations internes – avancée (ADIR)</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS31	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,00 %, 0,10 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $0,00 \% \leq x < 0,10 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS32	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,10 %, 0,25 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $0,10 \% \leq x < 0,25 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS33	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,25 %, 1,00 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $0,25 \% \leq x < 1,00 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS34	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [1,00 %, 7,50 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $1,00 \% \leq x < 7,50 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS35	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [7,50 %, 20,00 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $7,50 \% \leq x < 20,00 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS36	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [20,00 %, 100,00 %]	Encours total des expositions sous-jacentes dont la probabilité de défaut un an à l'avance a été évaluée comme étant située dans la fourchette $20,00 \% \leq x < 100,00 \%$. Cette estimation peut provenir soit de l'initiateur, soit de la banque centrale nationale concernée. S'il n'y a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la probabilité de défaut, entrer ND5.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS37	Estimation interne de la perte en cas de défaut	Estimation par l'initiateur de la perte en cas de défaut pour l'exposition sous-jacente dans un scénario de ralentissement, pondéré par l'encours total du capital des expositions sous-jacentes à la date d'arrêt des données. S'il n'a pas d'exigence réglementaire en matière de calcul de la perte en cas de défaut, entrer ND5.	NON	OUI
IVSS38	Arriérés 1-29 jours	Pourcentage des expositions de ce type présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 1 à 29 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions de ce type pour cette catégorie d'arriérés à la date d'arrêt des données et l'encours total en principal de toutes les expositions de ce type à la date d'arrêt des données.	NON	NON
IVSS39	Arriérés 30-59 jours	Pourcentage d'expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 30 à 59 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON
IVSS40	Arriérés 60-89 jours	Pourcentage d'expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 60 à 89 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON
IVSS41	Arriérés 90-119 jours	Pourcentage d'expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 90 à 119 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON
IVSS42	Arriérés 120-149 jours	Pourcentage d'expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 120 à 149 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSS43	Arriérés 150-179 jours	Pourcentage d'expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 150 à 179 jours (dernier jour inclus) à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON
IVSS44	Arriérés 180 jours ou +	Pourcentage des expositions présentant des arriérés de versement du capital et/ou des intérêts dus pour une période de 180 jours ou plus à la date d'arrêt des données. Ce pourcentage est calculé en tant que rapport entre l'encours total en principal des expositions dans cette catégorie d'arriérés, à la date d'arrêt des données, et l'encours total en principal de toutes les expositions à la date d'arrêt des données.	NON	NON

Informations sur les tests/événements/déclencheurs

IVSR1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ IVSS1.	NON	NON
IVSR2	Identifiant initial du test/événement/déclencheur	Identifiant unique initial du test/événement/déclencheur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVSR3	Nouvel identifiant du test/événement/déclencheur	Si l'identifiant initial dans le champ IVSR2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ IVSR2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVSR4	Description	Décrire le test/événement/déclencheur, y compris les formules. Ce champ est une zone de texte libre, toutefois la description du test/événement/déclencheur inclut les formules et les définitions clés qui permettent à un investisseur/investisseur potentiel de se faire une idée raisonnable du test/événement/déclencheur ainsi que des conditions et conséquences associées.	NON	NON
IVSR5	Niveau seuil	Entrer le niveau auquel le test est réputé satisfaisant, le seuil déclencheur est réputé dépassé ou le niveau auquel toute autre action est réputée survenir, le cas échéant en fonction du type de test/événement/déclencheur déclaré. En cas de tests/événements/déclencheurs non numériques, entrer ND5.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSR6	Valeur actuelle	Entrer la valeur actuelle de la mesure comparée au niveau seuil. En cas de tests/événements/déclencheurs non numériques, entrer ND5. En cas d'indication de pourcentages, ces derniers doivent être entrés sous forme de points de pourcentage, par exemple 99,50 pour 99,50 %, 0,006 pour 0,006 %.	NON	OUI
IVSR7	Statut	Le statut du test/événement/déclencheur est-il défini comme «Non-conformité» (c'est-à-dire, le test n'est pas satisfaisant ou les conditions de déclenchement sont remplies) à la date d'arrêt des données?	NON	NON
IVSR8	Période de rétablissement	Entrer le nombre maximal de jours accordé pour remettre ce test/seuil déclencheur en conformité avec le niveau requis. Si aucun délai n'a été accordé (à savoir, en l'absence de période de rétablissement), entrer 0.	NON	OUI
IVSR9	Fréquence de calcul	Entrer le nombre de jours calendaires d'intervalle pour le calcul des résultats du test. Utiliser des chiffres ronds, par exemple 7 pour une fréquence hebdomadaire, 30 pour une fréquence mensuelle, 90 pour une fréquence trimestrielle et 365 pour une fréquence annuelle.	NON	OUI
IVSR10	Conséquence en cas de non-conformité	Entrer la conséquence, conformément à la documentation de la titrisation, en cas de test/événement/déclencheur non satisfaisant (c'est-à-dire, en cas de non-conformité): Changement dans l'ordre de priorité des paiements (CHPP) Remplacement d'une contrepartie (CHCP) Changement dans l'ordre de priorité des paiements et remplacement d'une contrepartie (BOTH) Autre conséquence (OTHR)	NON	NON

Informations sur les flux de trésorerie

IVSF1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ IVSS1.	NON	NON
IVSF2	Identifiant initial de l'élément de flux de trésorerie	Identifiant unique initiale de l'élément de flux de trésorerie. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVSF3	Nouvel identifiant de l'élément de flux de trésorerie	Si l'identifiant initial dans le champ IVSF2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ IVSF2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVSF4	Élément de flux de trésorerie	Indiquer l'élément de flux de trésorerie. Ce champ doit être complété dans l'ordre de priorité d'encaissement ou de décaissement applicable à la date d'arrêt des données. C'est-à-dire, chaque source d'entrée de trésorerie doit être énumérée successivement, après que les sources de sortie de trésorerie doivent être énumérées.	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVSF5	Montant versé au cours de la période	<p>Quels sont les fonds versés conformément à la priorité des paiements pour cet élément? Entrer des valeurs négatives pour les fonds versés et des valeurs positives pour les fonds reçus. Noter que la somme de la valeur du «Montant versé au cours de la période» entrée dans une ligne donnée (par exemple, en ligne B) et de la valeur des «Fonds disponibles post» entrée dans la ligne précédente (par exemple, en ligne A) est égale à la valeur des «Fonds disponibles post» entrée dans cette ligne (par exemple, ligne B).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	NON
IVSF6	Fonds disponibles post	<p>Quels sont les fonds disponibles pour la priorité des paiements après l'application de l'élément de flux de trésorerie? Noter que la somme de la valeur du «Montant versé au cours de la période» entrée dans une ligne donnée (par exemple, en ligne B) et de la valeur des «Fonds disponibles post» entrée dans la ligne précédente (par exemple, en ligne A) est égale à la valeur des «Fonds disponibles post» entrée dans cette ligne (par exemple, ligne B).</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	NON

▼ B

ANNEXE XIII

▼ C1INFORMATIONS DEVANT FIGURER DANS LES RAPPORTS DESTINÉS AUX INVESTISSEURS —
TITRISATION ABCP▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur le programme				
IVAS1	Identifiant unique – Programme ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante à ce programme ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
IVAS2	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données.	NON	NON
IVAS3	Nom de l'entité déclarante	Dénomination sociale complète de l'entité visée à l'article 7, paragraphe 2, du règlement (UE) 2017/2402; cette dénomination doit correspondre à la dénomination entrée pour cette entité dans le champ SEAP3 de la section relative aux informations sur les contreparties. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
IVAS4	Personne de contact de l'entité déclarante	Nom et prénom de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVAS5	Coordonnées téléphoniques de l'entité déclarante	Numéro(s) de téléphone direct(s) de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVAS6	Coordonnées électroniques de l'entité déclarante	Adresse(s) électronique(s) directe(s) de la ou des personne(s) de contact chargée(s) de préparer la présente communication de données sur la titrisation et à qui doivent être adressées les questions y afférentes.	NON	NON
IVAS7	Mesures/ratios de déclenchement	Un événement déclencheur lié aux expositions sous-jacentes est-il survenu? Cela inclut un retard, une dilution, un défaut, un arrêt de substitution, un arrêt de renouvellement ou un événement similaire lié aux expositions sous-jacentes affectant la titrisation, à la date d'arrêt des données. Cela inclut également un éventuel solde débiteur sur un registre des impayés en principal ou la défaillance éventuelle d'un actif.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAS8	Expositions non conformes	Conformément à l'article 26, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/2402, entrer la valeur totale des expositions, sur la base de l'encours actuel à la date d'arrêt des données, non conformes à l'article 24, paragraphes 9, 10 et 11, du règlement (UE) 2017/2402. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	OUI	OUI
IVAS9	Durée de vie moyenne pondérée	Entrer la durée de vie moyenne pondérée restante du panier des expositions sous-jacentes à ce programme ABCP, exprimée en années.	OUI	OUI
IVAS10	Méthode de rétention du risque	Méthode utilisée pour se conformer aux exigences en matière de rétention du risque dans l'Union européenne [par exemple, article 6 du règlement (UE) 2017/2402 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013]: Tranche verticale, à savoir article 6, paragraphe 3, point a) (VSLC) Part du vendeur, à savoir article 6, paragraphe 3, point b) (SLLS) Expositions choisies d'une manière aléatoire maintenues au bilan, à savoir article 6, paragraphe 3, point c) (RSEX) Tranche de première perte, à savoir article 6, paragraphe 3, point d) (FLTR) Exposition de première perte pour chaque actif, à savoir article 6, paragraphe 3, point e) (FLEX) Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM) Autre (OTHR)	NON	OUI
IVAS11	Entité conservant le risque	Entité conservant l'intérêt économique net significatif, conformément à l'article 6 du règlement (UE) 2017/2402 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013: Initiateur (ORIG) Sponsor (SPON) Prêteur initial (OLND) Vendeur (SELL) Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM) Autre (OTHR)	NON	OUI

Informations sur l'opération

IVAN1	Identifiant unique – Programme ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de programme ABCP que celui entré dans le champ IVAS1.	NON	NON
IVAN2	Identifiant unique – Opération ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante à cette opération ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAN3	Date d'arrêté des données	Date d'arrêté des données pour la présente communication de données Cette date doit correspondre à la date d'arrêté des données figurant dans les modèles pour les expositions sous-jacentes présentés en annexe XI.	NON	NON
IVAN4	Code NACE de l'activité	Code NACE de l'activité de l'initiateur, conformément au règlement (CE) n° 1893/2006.	NON	OUI
IVAN5	Méthode de rétention du risque	Méthode utilisée pour se conformer aux exigences en matière de rétention du risque dans l'Union européenne [par exemple, article 6 du règlement (UE) 2017/2402 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013]: Tranche verticale, à savoir article 6, paragraphe 3, point a) (VSLC) Part du vendeur, à savoir article 6, paragraphe 3, point b) (SLLS) Expositions choisies d'une manière aléatoire maintenues au bilan, à savoir article 6, paragraphe 3, point c) (RSEX) Tranche de première perte, à savoir article 6, paragraphe 3, point d) (FLTR) Exposition de première perte pour chaque actif, à savoir article 6, paragraphe 3, point e) (FLEX) Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM) Autre (OTHR)	NON	OUI
IVAN6	Entité conservant le risque	Entité conservant l'intérêt économique net significatif, conformément à l'article 6 du règlement (UE) 2017/2402 ou, jusqu'à son entrée en vigueur, l'article 405 du règlement (UE) n° 575/2013: Initiateur (ORIG) Sponsor (SPON) Prêteur initial (OLND) Vendeur (SELL) Non-respect des exigences en matière de rétention du risque (NCOM) Autre (OTHR)	NON	OUI
IVAN7	Durée de vie moyenne pondérée	Entrer la durée de vie moyenne pondérée restante du panier des expositions sous-jacentes à cette opération, exprimée en années.	OUI	OUI

Informations sur les tests/événements/déclencheurs

IVAR1	Identifiant unique – Opération ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de l'opération ABCP que celui entré dans le champ IVAN2.	NON	NON
IVAR2	Identifiant initial du test/événement/déclencheur	Identifiant unique initial du test/événement/déclencheur. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
IVAR3	Nouvel identifiant du test/événement/déclencheur	Si l'identifiant initial dans le champ IVAR2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ IVAR2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
IVAR4	Description	Décrire le test/événement/déclencheur, y compris les formules. Ce champ est une zone de texte libre, toutefois la description du test/événement/déclencheur inclut les formules et les définitions clés qui permettent à un investisseur/investisseur potentiel de se faire une idée raisonnable du test/événement/déclencheur ainsi que des conditions et conséquences associées.	NON	NON
IVAR5	Statut	Le test a-t-il été satisfaisant à la date d'arrêt des données? En cas de déclencheur, le seuil déclencheur est-il dépassé?	NON	NON
IVAR6	Conséquence en cas de non-conformité	Entrer la conséquence, conformément à la documentation de la titrisation, en cas de test/événement/déclencheur non satisfaisant (c'est-à-dire, en cas de non-conformité): Changement dans l'ordre de priorité des paiements (CHPP) Remplacement d'une contrepartie (CHCP) Changement dans l'ordre de priorité des paiements et remplacement d'une contrepartie (BOTH) Autre conséquence (OTHR)	NON	NON

▼ B

ANNEXE XIV

▼ C1INFORMATIONS PRIVILÉGIÉES OU INFORMATIONS SUR LES ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS —
TITRISATION AUTRE QU'ABCP▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur la titrisation				
SESS1	Identifiant unique	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
SESS2	Date d'arrêt des données	Date d'arrêt des données pour la présente communication de données Lorsqu'elle est présentée en même temps que la communication des données sur les expositions sous-jacentes et les rapports destinés aux investisseurs, cette date doit correspondre à la date d'arrêt des données figurant dans les modèles applicables présentés pour les expositions sous-jacentes et les rapports destinés aux investisseurs.	NON	NON
SESS3	À cessé d'être STS	La titrisation a-t-elle cessé d'être conforme aux exigences STS? Si la titrisation n'a jamais eu le statut STS, entrer ND5.	NON	OUI
SESS4	Mesures correctives	Les autorités compétentes ont-elles pris des mesures correctives concernant cette titrisation? Si la titrisation n'est pas une titrisation STS, entrer ND5.	NON	OUI
SESS5	Mesures administratives	Les autorités compétentes ont-elles pris des mesures administratives à l'égard de cette titrisation? Si la titrisation n'est pas une titrisation STS, entrer ND5.	NON	OUI
SESS6	Modification significative des documents concernant l'opération	Décrire toute modification significative des documents concernant l'opération, en incluant le nom et le code (conformément au tableau 3 de l'annexe I) du document ainsi qu'une description détaillée des modifications.	NON	OUI
SESS7	Perfection de la cession	Conformément à l'article 20, paragraphe 5, du règlement (UE) 2017/2402, le transfert d'expositions sous-jacentes à la SSPE (à savoir, perfection de vente) est-il effectué après la date de clôture de la titrisation?	NON	OUI
SESS8	Type actuel de cascade	Sélectionner dans la liste ci-dessous le type de cascade le plus proche actuellement applicable à la titrisation: Cascade turbo (TRWT) Cascade séquentielle (SQWT) Cascade prorata (PRWT) Cascade actuellement séquentielle, avec la possibilité de devenir prorata dans l'avenir (SQPR) Cascade actuellement prorata, avec la possibilité de devenir séquentielle dans l'avenir (SQPR) Autre (OTHR)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESS9	Type de fiducie globale (Master Trust)	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, sélectionner la description la plus appropriée de la structure:</p> <p>Chaque SSPE est indépendante des autres SSPE en ce qui concerne l'émission de titres et la distribution de la trésorerie (également appelé «structure capitaliste») (CSTR)</p> <p>Les pertes sont partagées entre toutes les SSPE et des catégories uniques de titres sont émises indépendamment des catégories de rang supérieur ou inférieur (également appelé «structure socialiste» ou «fiducie globale dissociée») (SSTR)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI
SESS10	Valeur de la SSPE	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer la valeur faciale de toutes les expositions sous-jacentes (principal et charges) dans lesquelles la fiducie ou la SSPE a un intérêt bénéficiaire à la date d'arrêt des données.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
SESS11	Valeur en principal de la SSPE	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer la valeur faciale de toutes les expositions sous-jacentes (principal uniquement) dans lesquelles la fiducie a un intérêt bénéficiaire à la date d'arrêt des données.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
SESS12	Nombre de comptes de la SSPE	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer le nombre de comptes dans lesquels la fiducie ou la SSPE a un intérêt bénéficiaire à la date d'arrêt des données.</p>	NON	OUI
SESS13	Encours en principal des titres	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer la valeur faciale de tous les titres adossés à des actifs et garantis par les expositions sous-jacentes dans la fiducie.</p> <p>Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NON	OUI
SESS14	Part du vendeur	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer l'intérêt de l'initiateur dans la fiducie, exprimé en pourcentage. En cas d'initiateurs multiples, entrer l'intérêt agrégé pour tous les initiateurs.</p>	NON	OUI
SESS15	Part de financement	<p>Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer l'intérêt de la SSPE de cette série dans la fiducie à la date d'arrêt des données, exprimé en pourcentage.</p>	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESS16	Revenus alloués à cette série	Si la titrisation a une structure de fiducie globale, entrer le montant des recettes allouées à cette série par la fiducie. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SESS17	Indice de référence du swap de taux d'intérêt	Décrire le type de l'indice de référence du swap de taux d'intérêt sur lequel la jambe payeuse du swap est fixée: MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESS18	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESS19	Notionnel du swap de taux d'intérêt	Montant notionnel du swap de taux d'intérêt à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SESS20	Monnaie du payeur du swap de devises	Entrer la devise dans laquelle la jambe payeuse du swap effectue les paiements.	NON	OUI
SESS21	Monnaie du receveur du swap de devises	Entrer la devise dans laquelle la jambe receveuse du swap effectue les paiements.	NON	OUI
SESS22	Taux de change pour swap de devises	Taux de change ayant été fixé pour un swap de devises.	NON	OUI
SESS23	Date d'échéance du swap de devises	Date d'échéance du swap de devises.	NON	OUI
SESS24	Notionnel du swap de devises	Montant notionnel du swap de devises à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

Informations au niveau des tranches/obligations

SEST1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SEST2	Identifiant initial de la tranche	Identifiant unique initial attribué à cet instrument. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEST3	Nouvel identifiant de la tranche	Si l'identifiant initial dans le champ SEST2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer la valeur dans le champ SEST2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEST4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	Code ISIN attribué à cette tranche, le cas échéant.	NON	OUI
SEST5	Nom de la tranche	Désignation (généralement une lettre et/ou un chiffre) donnée à cette tranche d'obligations (ou catégorie de titres) qui présente les mêmes droits, priorités et caractéristiques que ceux définis dans le prospectus, par exemple série 1, classe A1, etc.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEST6	Type de tranche/ d'obligation	Sélectionner l'option la plus appropriée pour décrire le profil de remboursement de l'instrument: Hard bullet (à savoir, date d'échéance fixe) (HBUL) Soft bullet (à savoir, la date d'échéance prévue peut-être reportée à la date d'échéance légale) (SBUL) Amortissement prévu (à savoir, remboursement du principal aux dates d'amortissement prévues) (SAMO) Amortissement contrôlé (à savoir, le remboursement du principal débute à une période déterminée) (CMM) Autre (OTHR)	NON	NON
SEST7	Monnaie	Monnaie dans laquelle est libellé l'instrument.	NON	NON
SEST8	Encours initial du capital	Encours initial du capital de cette tranche à l'émission. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEST9	Encours actuel du capital	Montant au pair ou notionnel de l'encours de cette tranche après la date de versement du capital actuel. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEST10	Périodicité de paiement des intérêts	Périodicité à laquelle il est prévu que les intérêts soient versés sur cet instrument: Mensuel (MNTM) Trimestriel (QTRM) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	NON
SEST11	Date de paiement des intérêts	Première date, après la date d'arrêt des données déclarée, à laquelle est prévue la distribution des intérêts aux porteurs de cette tranche d'obligations.	NON	OUI
SEST12	Date de paiement du principal	Première date, après la date d'arrêt des données déclarée, à laquelle sont prévus les remboursements du capital aux porteurs de cette tranche d'obligations.	NON	OUI
SEST13	Coupon actuel	Coupon de l'instrument en points de base.	NON	NON
SEST14	Marge/spread de taux d'intérêt actuel	Écart de coupon appliqué à l'indice de référence du taux d'intérêt tel que défini dans le document d'offre applicable à l'instrument spécifique, en points de base.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEST15	Plancher du coupon	Plancher du coupon de l'instrument.	NON	OUI
SEST16	Plafond du coupon	Plafond du coupon de l'instrument.	NON	OUI
SEST17	Valeur du coupon augmenté/diminué (Step-Up/Step-Down)	Le cas échéant, quelle est la valeur du coupon augmenté/diminué conformément aux conditions de la titrisation/du programme?	NON	OUI
SEST18	Date du coupon augmenté/diminué (Step-Up/Step-Down)	Le cas échéant, quelle est la date à laquelle la définition du coupon est censée être modifiée conformément aux conditions de la titrisation/du programme?	NON	OUI
SEST19	Convention relative aux jours ouvrables	Convention relative aux jours ouvrables utilisée pour le calcul des intérêts dus: Suivant (FWNG) Suivant modifié (MODF) Le plus proche (NEAR) Précédent (PREC) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEST20	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
SEST21	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEST22	Date d'émission	Date à laquelle cet instrument a été émis.	NON	NON
SEST23	Date de début de calcul des intérêts	Première date à laquelle le montant des intérêts dus sur l'instrument est calculé.	NON	OUI
SEST24	Date d'échéance légale	Date avant laquelle cet instrument doit être remboursé pour ne pas être en défaut.	NON	OUI
SEST25	Clause de prolongation	Sélectionner l'option la plus appropriée pour décrire la partie habilitée à prolonger l'échéance de l'instrument, conformément aux conditions de la titrisation/du programme: SSPE uniquement (ISUR) Porteur de titres (NHLD) SSPE ou porteur de titres (ISNH) Pas d'option (NOPT)	NON	OUI
SEST26	Prochaine date de rachat	Quelle est la prochaine date à laquelle l'instrument peut être racheté, conformément aux conditions de la titrisation/du programme? À l'exclusion des accords de retrait anticipé.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEST27	Seuil de retrait anticipé (Clean-Up Call)	Quel est le seuil de retrait anticipé conformément aux conditions de la titrisation/du programme?	NON	OUI
SEST28	Prochaine date d'option de vente (Put)	Quelle est la prochaine date d'option de vente conformément aux conditions de la titrisation/du programme?	NON	OUI
SEST29	Convention de calcul des jours	Convention sur le décompte des «jours» servant à calculer les intérêts: 30/360 (A011) Réel/365 (A005) Réel/360 (A004) Réel/réel ICMA (A006) Réel/réel ISDA (A008) Réel/réel AFB (A010) Réel/366 (A009) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEST30	Convention de règlement	Convention de règlement habituelle pour la tranche: T plus un (TONE) T plus deux (TTWO) T plus trois (TTRE) Dès que possible (ASAP) À l'issue du contrat (ENDC) Fin de mois (MONT) Futur (FUTU) Jour suivant (NXTD) Régulier (REGU) T plus cinq (TFIV) T plus quatre (TFOR) En cas d'émission (WHIF) Lors de la distribution (WDIS) Lors de l'émission (WISS) Lors de l'émission ou de la distribution (WHID) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEST31	Point d'attachement actuel	Point d'attachement actuel de la tranche, calculé conformément à l'article 256 du règlement (UE) n° 575/2013, et multiplié par 100.	NON	NON
SEST32	Point d'attachement initial	Point d'attachement initial de la tranche au moment de l'émission des titres de la tranche, calculé conformément à l'article 256 du règlement (UE) n° 575/2013, et multiplié par 100.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEST33	Rehaussement de crédit actuel	Rehaussement de crédit actuel de la tranche, calculé conformément à la définition de l'initiateur/du sponsor/de la SSPE.	NON	NON
SEST34	Rehaussement de crédit initial	Rehaussement de crédit initial de la tranche au moment de l'émission des titres de la tranche, calculé conformément à la définition de l'initiateur/du sponsor/de la SSPE.	NON	OUI
SEST35	Formule de rehaussement de crédit	Décrire/entrer la formule utilisée pour calculer le rehaussement de crédit de la tranche.	NON	NON
SEST36	Tranches de rang égal	Entrer le code ISIN de toutes les tranches (y compris de celle-ci) qui, à la date d'arrêt des données, sont de rang égal à la tranche actuelle selon l'ordre de priorité des paiements dans la titrisation à la date d'arrêt des données. En cas de codes ISIN multiples, tous les codes ISIN doivent être fournis conformément au schéma XML.	NON	OUI
SEST37	Tranches de rang supérieur	Entrer le code ISIN de toutes les tranches qui, à la date d'arrêt des données, sont de rang supérieur à la tranche actuelle selon l'ordre de priorité des paiements dans la titrisation à la date d'arrêt des données. En cas de codes ISIN multiples, tous les codes ISIN doivent être fournis conformément au schéma XML.	NON	OUI
SEST38	Encours inscrit au registre des impayés en principal	Encours inscrit au registre des impayés en principal de la tranche concernée. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEST39	Identifiant d'entité juridique du garant	Si la tranche a été garantie, indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du garant. S'il n'y a pas de garantie, entrer ND5.	NON	OUI
SEST40	Nom du garant	Indiquer la dénomination sociale complète du garant. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF). S'il n'y a pas de garantie, entrer ND5.	NON	OUI
SEST41	Sous-secteur SEC du garant	Classement SEC 2010 du garant conformément au règlement (UE) n° 549/2013 («SEC 2010»). Cette entrée doit être fournie au niveau du sous-secteur. Utiliser l'une des valeurs figurant dans le tableau 1 de l'annexe 1 du présent règlement. S'il n'y a pas de garantie, entrer ND5.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEST42	Type de protection	Indiquer le type d'instrument de protection utilisé: Contrat d'échange sur le risque de défaut (CDSX) Émission liée au Crédit (CLKN) Swap sur rendement total (TRES) Garantie financière (également appelée «atténuation du risque de crédit non financé») (FGUA) Assurance-crédit (CINS) Autre (OTHR)	NON	OUI

Informations au niveau du compte

SESA1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESA2	Identifiant initial du compte	Identifiant unique initial du compte. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SESA3	Nouvel identifiant du compte	Si l'identifiant initial dans le champ SESA2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ SESA2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SESA4	Type de compte	Type du compte: Compte de trésorerie (CARE) Compte commun (CORE) Compte de compensation (SORE) Facilité de trésorerie (LQDF) Compte de marge (MGAC) Autre compte (OTHR)	NON	NON
SESA5	Solde cible du compte	Montant des fonds qui sont en dépôt sur le compte concerné lorsqu'il est entièrement financé, conformément à la documentation de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SESA6	Solde effectif du compte	Solde des fonds en dépôt sur le compte concerné à la date de fin du cumul. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESA7	Amortissement du compte	Le compte est-il amorti tout au long de la durée de vie de la titrisation?	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
---------------	--------------	--------------------	-------------------	---------------

Informations au niveau de la contrepartie

SESP1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESP2	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de la contrepartie.	NON	NON
SESP3	Nom de la contrepartie	Indiquer la dénomination sociale complète de la contrepartie. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
SESP4	Type de contrepartie	Type de contrepartie: Banque du compte (ABNK) Banque du compte de secours (BABN) Facilitateur de la banque du compte (ABFC) Garant de la banque du compte (ABGR) Agent des garanties (CAGT) Agent des paiements (PAYA) Agent de calcul (CALC) Agent administratif (AMDI) Sous-agent administratif (ADSA) Agent de transfert (RANA) Agent de vérification (VERI) Agent des sûretés (SECU) Fournisseur d'avance de trésorerie (CAPR) Fournisseur de sûretés réelles (COLL) Fournisseur de contrats d'investissement garanti (GICP) Fournisseur d'assurance-crédit (IPCP) Fournisseur de facilités de trésorerie (LQFP) Fournisseur de facilités de trésorerie de secours (BLQP) Participant à un prêt hypothécaire sur épargne (SVMP) Émetteur (ISSR) Initiateur (ORIG) Vendeur (SELL) Sponsor de l'entité de titrisation (SSSP) Organe de gestion (SERV) Organe de gestion de secours Facilitateur de l'organe de gestion de secours (BSRF)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Organe de gestion spécial (SSRV) Souscripteur (SUBS) Fournisseur de swap de taux d'intérêt (IRSP) Fournisseur de swap de taux d'intérêt de secours (BIPR) Fournisseur de swap de devises (CSPR) Fournisseur de swap de devises de secours (BCSP) Auditeur (AUDT) Conseiller (CNSL) Mandataire (TRUS) Représentant des porteurs de titres (REPN) Preneur ferme (UNDR) Arrangeur (ARRG) Négociant (DEAL) Gestionnaire (MNGR) Fournisseur de lettres de crédit (LCPR) Conduit Multi-Cédant (MSCD) Entité de titrisation (SSPE) Agent de liquidité ou de liquidation (LQAG) Actionnaire du conduit/SSPE (EQOC) Fournisseur de facilité de tirage en valeur jour (LQFP) Fournisseur de prêts ou de contrats de location pour start-ups (SULP) Contrepartie à la mise en pension (RAGC) Gestionnaire de trésorerie (CASM) Banque du compte d'encaissement (BABN) Banque du compte de la sûreté (BABN) Fournisseur de prêt subordonné (SBLP) Gestionnaire de titres adossés à des prêts aux entreprises (CLOM) Conseiller du portefeuille (PRTA) Agent de substitution (SUBA) Autre (OTHR)		
SESP5	Pays d'établissement de la contrepartie	Pays dans lequel est établie la contrepartie.	NON	NON
SESP6	Seuil de notation de la contrepartie	Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer le seuil de notation de la contrepartie à la date d'arrêté des données. En cas de notations multiples, toutes les notations doivent être indiquées conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESP7	Notation de la contrepartie	<p>Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer la note de la contrepartie à la date d'arrêt des données.</p> <p>En cas de seuils de notation multiples, tous les seuils de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.</p>	NON	OUI
SESP8	Identifiant d'entité juridique de la source de la notation de la contrepartie	<p>Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer l'identifiant d'entité juridique du fournisseur de la notation de la contrepartie [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] à la date d'arrêt des données.</p> <p>En cas de notations multiples, tous les identifiants des fournisseurs de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.</p>	NON	OUI
SESP9	Nom de la source de la notation de la contrepartie	<p>Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer le nom complet du fournisseur de la notation de la contrepartie à la date d'arrêt des données. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).</p> <p>En cas de notations multiples, tous les identifiants des fournisseurs de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.</p>	NON	OUI

Informations sur les titrisations CLO

SESC1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESC2	Date de fin de la période sans rachat (Non-Call)	Entrer la date à laquelle toutes les périodes sans rachat se terminent (par exemple, lorsque les porteurs des tranches ne sont pas autorisés à demander à la SSPE de liquider le portefeuille et de rembourser toutes les tranches, de réviser ou de refinancer les tranches, etc.).	NON	OUI
SESC3	Type de CLO	<p>Type de CLO qui décrit le mieux cette opération:</p> <p>Titre adossé à des prêts aux entreprises de bilan (BCLO)</p> <p>Titre adossé à des prêts aux entreprises d'arbitrage (ACLO)</p> <p>Autre (OTHR)</p>	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESC4	Période actuelle	Statut de la période actuelle du CLO: Entrepôt (WRHS) Démarrage (RMUP) Réinvestissement (RINV) Post-réinvestissement (PORI) Autre (OTHR)	NON	NON
SESC5	Date de début de la période actuelle	Entrer la date à laquelle a débuté la période actuelle.	NON	OUI
SESC6	Date de fin de la période actuelle	Entrer la date à laquelle prendra fin/devrait prendre fin la période actuelle.	NON	OUI
SESC7	Limite de concentration	Entrer la limite de concentration, en pourcentage de la valeur au pair du portefeuille, qui s'applique à tout(e) contrepartie/débiteur, comme indiqué dans la documentation de l'opération. En cas de limites multiples, entrer la limite maximale (par exemple, s'il y a deux limites, en fonction de la notation, de 10 % et de 20 %, entrer 20 %).	NON	OUI
SESC8	Restrictions — Échéance légale	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'expositions dont l'échéance légale finale dépasse l'échéance légale finale la plus courte des tranches (en supposant que l'option de retrait anticipé est exercée)?	NON	OUI
SESC9	Restrictions — Expositions subordonnées	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'expositions avec privilège de second rang qui peuvent être achetées?	NON	OUI
SESC10	Restrictions — Expositions non performantes	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'expositions non performantes qui peuvent être achetées?	NON	OUI
SESC11	Restrictions — Expositions PIK	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'expositions PIK (pay-in-kind) qui peuvent être détenues à tout moment?	NON	OUI
SESC12	Restrictions — Expositions coupon zéro	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'expositions à coupon zéro qui peuvent être détenues à tout moment?	NON	OUI
SESC13	Restrictions — Expositions actions	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) d'actions ou de dette convertible en actions qui peuvent être achetées?	NON	OUI
SESC14	Restrictions — Expositions participations	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) de participations dans le prêt qui peuvent être achetées?	NON	OUI
SESC15	Restrictions — Ventes discrétionnaires	Pourcentage autorisé (par rapport à l'encours au pair du portefeuille) de ventes discrétionnaires par an?	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESC16	Ventes discrétionnaires	Ventes discrétionnaires réelles, cumul annuel jusqu'à ce jour. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESC17	Réinvestissements	Montant réinvesti, cumul annuel jusqu'à ce jour. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESC18	Restrictions — Rehaussement de crédit	Le gestionnaire de CLO peut-il retirer ou monétiser tout rehaussement de crédit supplémentaire?	NON	NON
SESC19	Restrictions — Offres de prix	Le gestionnaire de CLO peut-il obtenir des offres de prix auprès de négociants autres que l'arrangeur?	NON	NON
SESC20	Restrictions — Transactions	Le gestionnaire de CLO peut-il obtenir des transactions auprès de négociants autres que l'arrangeur?	NON	NON
SESC21	Restrictions — Émissions	Y a-t-il des restrictions sur l'émission supplémentaire de titres?	NON	NON
SESC22	Restrictions — Remboursements	Y a-t-il des restrictions sur l'origine des fonds utilisés pour le rachat/remboursement sélectif de titres (par exemple, le produit du capital ne peut pas être utilisé pour effectuer un remboursement; tout remboursement doit avoir lieu dans l'ordre de priorité de paiement des titres; les ratios de tests de surcollatéralisation doivent être maintenus ou améliorés après achat)?	NON	NON
SESC23	Restrictions — Refinancement	Y a-t-il des restrictions en cas de refinancement des titres?	NON	NON
SESC24	Restrictions — Rémunération titres	Les porteurs de titres peuvent-ils céder leurs titres au mandataire à des fins d'annulation sans recevoir de paiement en contrepartie?	NON	NON
SESC25	Restrictions — Protection de crédit	Le gestionnaire de CLO peut-il acheter ou vendre la protection de crédit sur les actifs sous-jacents?	NON	NON
SESC26	Délai de liquidation des sûretés	Entrer le nombre de jours calendaires après lesquels les sûretés peuvent être liquidées. En cas de multiples périodes possibles, entrer le nombre minimal de jours calendaires.	NON	OUI
SESC27	Liquidation des sûretés — Renoncement	Certains porteurs de titres ou tous les porteurs de titres peuvent-ils choisir de renoncer à la période de liquidation des sûretés?	NON	NON

Informations sur le gestionnaire de CLO

SESL1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
-------	--------------------	--	-----	-----

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESL2	Identifiant d'entité juridique du gestionnaire de CLO	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du gestionnaire de CLO.	NON	NON
SESL3	Nom du gestionnaire	Indiquer la dénomination sociale complète du gestionnaire de CLO. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
SESL4	Date d'établissement	Date de constitution/d'établissement du gestionnaire de CLO.	NON	OUI
SESL5	Date d'enregistrement	Date d'enregistrement dans l'Union européenne en tant que conseiller en placement.	NON	OUI
SESL6	Salariés	Nombre total de salariés.	NON	NON
SESL7	Salariés – CLO	Nombre total de salariés chargés de la négociation des prêts et de la gestion des portefeuilles de CLO.	NON	NON
SESL8	Salariés — Restructuration crédits	Nombre total de salariés chargés de la restructuration des crédits dépréciés.	NON	NON
SESL9	Actifs sous gestion	Actifs sous gestion. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL10	Actifs sous gestion — Prêts à effet de levier	Total de prêts à effet de levier sous gestion. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL11	Actifs sous gestion — CLO	Total de CLO sous gestion. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL12	Actifs sous gestion — UE	Total d'actifs UE sous gestion. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL13	Actifs sous gestion — CLO UE	Total de CLO UE sous gestion. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL14	Nombre de CLO UE	Nombre de CLO UE sous gestion.	NON	NON
SESL15	Capital	Capital total. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESL16	Capital — Rétection du risque	Capital pour le financement de la rétection du risque. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESL17	Durée de règlement	Durée moyenne nécessaire, en jours calendaires, pour le règlement d'opérations.	NON	NON
SESL18	Fréquence de détermination du prix	Fréquence (en nombre de jours) de détermination/nouvelle détermination du prix des portefeuilles. Si différentes fréquences s'appliquent, entrer la fréquence moyenne pondérée, en utilisant comme facteur de pondération les actifs sous gestion de chaque catégorie, arrondi au jour le plus proche.	NON	NON
SESL19	Taux de défaut — 1 an	Taux de défaut moyen annualisé des actifs liés à la titrisation CLO gérés par le gestionnaire de CLO, l'année dernière.	NON	NON
SESL20	Taux de défaut — 5 ans	Taux de défaut moyen annualisé des actifs liés à la titrisation CLO gérés par le gestionnaire de CLO, les cinq dernières années.	NON	NON
SESL21	Taux de défaut — 10 ans	Taux de défaut moyen annualisé des actifs liés à la titrisation CLO gérés par le gestionnaire de CLO, les dix dernières années.	NON	NON

Informations sur la couverture synthétique

SESV1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESV2	Identifiant de l'instrument de protection	Identifiant unique de l'instrument de protection. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SESV3	Type de protection	Indiquer le type d'instrument de protection utilisé: Contrat d'échange sur le risque de défaut (CDSX) Émission liée au Crédit (CLKN) Swap sur rendement total (TRES) Garantie financière (également appelée «atténuation du risque de crédit non financé») (FGUA) Assurance-crédit (CINS) Autre (OTHR)	NON	NON
SESV4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) de l'instrument de protection	Entrer le code ISIN de l'instrument de protection, le cas échéant.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV5	Nom du fournisseur de protection	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur de protection. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON
SESV6	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de protection	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur de protection.	NON	NON
SESV7	Entité publique dont la pondération de risque est zéro	Le fournisseur de protection est-il une entité publique classée en vertu des articles 113, paragraphe 4, 117, paragraphe 2, ou 118 du règlement (UE) n° 575/2013 (dans leur version en vigueur)?	NON	NON
SESV8	Droit applicable	Juridiction régissant le contrat de protection.	NON	NON
SESV9	Convention-cadre ISDA (ISDA Master Agreement)	Documentation de référence de la protection: Convention ISDA 2002 (ISDA) Convention ISDA 2014 (ISDA) Autre Convention ISDA (ISDA) Rhamenvertrag (DERV) Autre (OTHR)	NON	NON
SESV10	Événements de défaut et de résiliation	Où sont consignés les événements de défaut et de résiliation concernant les accords de protection? Annexe de l'ISDA 2002 (ISDA) Annexe de l'ISDA 2014 (ISDA) Autre – sur mesure (OTHER)	NON	OUI
SESV11	Type de titrisation synthétique	S'agit-il d'une «titrisation synthétique»?	NON	NON
SESV12	Monnaie de la protection	Devise dans laquelle est libellée la protection.	NON	NON
SESV13	Notionnel actuel de la protection	Montant total de la couverture au titre du contrat de protection, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV14	Notionnel maximum de la protection	Montant maximal de la couverture au titre du contrat de protection. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV15	Point d'attachement de la protection	En termes de principal du panier, entrer le point d'attachement, en pourcentage, auquel la couverture de la protection débute.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV16	Point de détachement de la protection	En termes de principal du panier, entrer le point d'attachement, en pourcentage, auquel la couverture de la protection se termine.	NON	OUI
SESV17	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) des titres couverts	Si la protection est fournie pour couvrir des tranches spécifiques (par exemple, une garantie, entrer le code ISIN de chaque tranche couverte par le contrat de protection spécifique. En cas de codes ISIN multiples, tous les codes ISIN doivent être fournis conformément au schéma XML.	NON	OUI
SESV18	Couverture de la protection	Indiquer l'option qui décrit le mieux la couverture du montant de la protection: Couvre la perte du principal uniquement (PRNC) Couvre la perte du principal et la perte des intérêts courus (PACC) Couvre la perte du principal, la perte des intérêts courus et les pénalités d'intérêts (PAPE) Couvre la perte du principal, la perte des intérêts courus et le coût de la saisie (PINF) Couvre la perte du principal, la perte des intérêts courus, les pénalités d'intérêts et le coût de la saisie (PIPF) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESV19	Date de fin de la protection	Entrer la date contractuelle à laquelle est prévue la fin/résiliation de la protection.	NON	OUI
SESV20	Seuils d'importance significative	Y a-t-il des seuils d'importance significative avant que les versements de protection puissent être effectués? Par exemple, un montant minimal de dégradation de crédit dans les actifs générateurs de flux de trésorerie est-il nécessaire avant de pouvoir introduire une demande de versement auprès du vendeur de protection?	NON	NON
SESV21	Conditions de libération des paiements	Conditions relatives à la libération des paiements effectués par le vendeur de protection: Immédiatement après un événement de crédit pour le montant total de l'actif en défaut (IFAM) Immédiatement après un événement de crédit pour le montant total des actifs en défaut net de recouvrement attendu (IFAR) Après une période prédéfinie autorisée pour l'activité d'encaissement (ACOL) Après une période prédéfinie autorisée pour les activités d'encaissement, pour une somme égale à la perte réelle moins le recouvrement attendu (APCR) Après la résolution complète de la perte, pour la perte réelle (AWRK) Autre (OTHR)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV22	Possibilité de paiements à des fins d'ajustement	Les conditions du contrat de protection de crédit prévoient-elles le versement de paiements d'ajustement à l'acheteur de protection (par exemple, si, après l'échéance du contrat de protection de crédit, il existe des écarts entre les montants estimés au préalable et les montants échangés)?	NON	NON
SESV23	Durée de la période de résolution	En ce qui concerne le calendrier des paiements, si une période prédéfinie est autorisée pour les activités d'encaissement prévues et tout ajustement à apporter au règlement initial de la perte, entrer le nombre de jours fixés pour la durée de cette période.	NON	OUI
SESV24	Obligation de rembourser	L'acheteur de protection est-il soumis à une obligation de rembourser les paiements de protection antérieurs reçus (hors résiliation du contrat dérivé, à la suite du déclenchement d'un événement de crédit, ou en cas de violation de garantie concernant les obligations de référence)?	NON	NON
SESV25	Possibilité de remplacement des sûretés	En cas de sûreté constituée, les actifs du portefeuille de sûretés peuvent-ils être remplacés? Ce champ devrait être complété pour les arrangements synthétiques financés, ou le cas échéant (par exemple, trésorerie détenue en tant que sûreté pour les paiements de protection).	NON	NON
SESV26	Exigences en matière de couverture des sûretés	En cas de sûreté constituée, entrer le pourcentage (en termes de notionnel de la protection) de couverture exigé, tel que stipulé dans la documentation de la titrisation. Ce champ devrait être complété pour les arrangements synthétiques financés, ou le cas échéant (par exemple, trésorerie détenue en tant que sûreté pour les paiements de protection).	NON	OUI
SESV27	Marge initiale des sûretés	Si une mise en pension est utilisée, entrer la marge initiale requise pour les investissements éligibles (sûretés), telle que stipulée dans la documentation de titrisation. Ce champ devrait être complété pour les arrangements synthétiques financés, ou le cas échéant (par exemple, trésorerie détenue en tant que sûreté pour les paiements de protection). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SESV28	Délai de livraison des sûretés	Si une mise en pension est utilisée, entrer la date limite (en jours), conformément à la documentation de la titrisation, à laquelle la sûreté doit être livrée, dans le cas où elle doit être libérée. Ce champ devrait être complété pour les arrangements synthétiques financés, ou le cas échéant (par exemple, trésorerie détenue en tant que sûreté pour les paiements de protection).	NON	OUI
SESV29	Règlement	Rémunération à verser: Cash (CASH) Règlement physique (PHYS)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV30	Date d'échéance maximale autorisée	En cas de règlement physique, indiquer la date d'échéance maximale stipulée dans la documentation de la titrisation pour les sûretés qui peuvent être livrées.	NON	OUI
SESV31	Indice de référence actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	Indice du taux d'intérêt courant (taux de référence à partir duquel sont fixés les paiements à l'acheteur de protection). Ce champ devrait notamment être complété en cas d'accords de protection fournis par le biais d'un swap: MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV32	Échéance de l'indice de référence actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	Échéance de l'indice de taux d'intérêt utilisé pour les paiements à l'acheteur de protection: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESV33	Fréquence de redéfinition des paiements — À l'acheteur de protection	Fréquence à laquelle les paiements à l'acheteur de protection sont révisés conformément au contrat de protection de crédit: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESV34	Marge de taux d'intérêt actuelle pour les paiements à l'acheteur de protection	Marge de taux d'intérêt actuelle appliquée aux paiements à taux variable à l'acheteur de protection. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur de l'indice de référence à partir de laquelle sont fixés les paiements à l'acheteur de protection. Ce champ devrait notamment être complété en cas d'accords de protection fournis par le biais d'un swap.	NON	OUI
SESV35	Taux d'intérêt actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	Taux d'intérêt actuel appliqué aux paiements à l'acheteur de protection. Ce champ devrait notamment être complété en cas d'accords de protection fournis par le biais d'un swap.	NON	OUI
SESV36	Indice de référence pour les paiements — Au vendeur de protection	Indice du taux d'intérêt courant (taux de référence à partir duquel sont fixés les paiements au vendeur de protection). MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
SESV37	Échéance de l'indice de référence actuel pour les paiements au vendeur de protection	Échéance de l'indice de taux d'intérêt utilisé pour les paiements au vendeur de protection: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV38	Fréquence de redéfinition des paiements au vendeur de protection	Fréquence à laquelle les paiements au vendeur de protection sont révisés conformément au contrat de protection de crédit: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESV39	Marge de taux d'intérêt actuelle pour les paiements au vendeur de protection	Marge de taux d'intérêt actuelle appliquée aux paiements à taux variable au vendeur de protection. Il s'agit de la marge positive (ou négative, dans ce cas entrer une valeur négative) ajoutée à la valeur de l'indice de référence à partir de laquelle sont fixés les paiements à l'acheteur de protection. Ce champ devrait notamment être complété en cas d'accords de protection fournis par le biais d'un swap.	NON	OUI
SESV40	Taux d'intérêt actuel pour les paiements au vendeur de protection	Taux d'intérêt actuel appliqué aux paiements au vendeur de protection.	NON	OUI
SESV41	Soutien de la marge excédentaire	La marge excédentaire sert-elle de rehaussement de crédit pour la catégorie de titres du rang le plus inférieur?	NON	NON
SESV42	Définition de la marge excédentaire	Conformément à la documentation de la titrisation, la marge excédentaire est définie en tant que marge excédentaire fixe (par exemple, le montant de la marge excédentaire disponible est prédéterminé, habituellement sous forme de pourcentage fixe).	NON	NON
SESV43	Statut actuel de la protection	Statut actuel de la protection, à la date d'arrêtés des données: Active (ACTI) Annulée (CANC) Désactivée (DEAC) Expirée (EXPI) Inactive (INAC) Retirée (WITH) Autre (OTHR)	NON	NON
SESV44	Faillite en tant qu'événement de crédit	La faillite du crédit de référence/débiteur figure-t-elle dans la définition des événements de crédit figurant du contrat de protection?	NON	NON
SESV45	Défaut de paiement en tant qu'événement de crédit	L'obligation de règlement du débiteur sous 90 jours figure-t-elle dans la définition des événements de crédit du contrat de protection?	NON	NON
SESV46	Restructuration en tant qu'événement de crédit	La restructuration du crédit de référence/débiteur figure-t-elle dans la définition des événements de crédit du contrat de protection?	NON	NON
SESV47	Événement de crédit	Une notification d'événement de crédit a-t-elle été remise?	NON	NON

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESV48	Paiements cumulés à l'acheteur de protection	Montant total des paiements effectués à l'acheteur de protection par le vendeur de protection, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV49	Paiements d'ajustement cumulés à l'acheteur de protection	Montant total des paiements d'ajustement effectués à l'acheteur de protection par le vendeur de protection, à la date d'arrêt des données (par exemple, pour rembourser la différence entre les paiements initiaux pour les pertes attendues et les paiements pour les pertes réelles subies par la suite sur les actifs générateurs de trésorerie dépréciés). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV50	Paiements cumulés au vendeur de protection	Montant total des paiements effectués au vendeur de protection par l'acheteur de protection, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV51	Paiements d'ajustement cumulés au vendeur de protection	Montant total des paiements d'ajustement effectués au vendeur de protection par l'acheteur de protection, à la date d'arrêt des données (par exemple, pour rembourser la différence entre les paiements initiaux pour les pertes attendues et les paiements pour les pertes réelles subies par la suite sur les actifs générateurs de trésorerie dépréciés). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESV52	Montant du registre de marge excédentaire synthétique	Montant total du registre de marge excédentaire synthétique, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

Informations sur l'émetteur des sûretés

SESI1	Identifiant unique	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESI2	Identifiant de l'instrument de protection	Indiquer ici le même identifiant unique que celui entré dans le champ SESV2.	NON	NON
SESI3	Identifiant initial de la sûreté	Identifiant unique initial attribué à la sûreté. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESI4	Nouvel identifiant de la garantie	Si l'identifiant initial dans le champ SESI3 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ SESI3. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SESI5	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) de la sûreté	Entrer le code ISIN de la sûreté, le cas échéant.	NON	OUI
SESI6	Type de sûreté	Type de sûreté: Cash (CASH) Obligation des administrations publiques (GBND) Papier commercial (CPAP) Dette bancaire non garantie (UBDT) Dette d'entreprise non garantie de rang supérieur (SUCD) Dette d'entreprise non garantie de rang inférieur (JUCD) Obligations sécurisées (CBND) Titre adossée à des actifs (ABSE) Autre (OTHR)	NON	NON
SESI7	Sous-secteur SEC de l'émetteur des sûretés	Classement SEC 2010 de la sûreté conformément au règlement (UE) n° 549/2013 («SEC 2010»). Cette entrée doit être fournie au niveau du sous-secteur. Utiliser l'une des valeurs figurant dans le tableau 1 de l'annexe 1 du présent règlement.	NON	OUI
SESI8	Identifiant d'entité juridique de l'émetteur des sûretés	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de l'émetteur des sûretés.	NON	NON
SESI9	Émetteur des sûretés affilié à l'initiateur?	L'émetteur des sûretés et l'initiateur principal de la titrisation partagent-ils la même société mère ultime?	NON	NON
SESI10	Encours actuel	Encours total du capital de la sûreté spécifique, à la date d'arrêtés des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SESI11	Monnaie de l'instrument	Libellé de la devise de l'instrument.	NON	NON
SESI12	Date d'échéance	Date d'échéance de la sûreté spécifique.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SESI13	Décote	Entrer le pourcentage de décote (appliqué à l'encours actuel du principal) de cette sûreté spécifique, tel que stipulé dans la documentation de la titrisation.	NON	OUI
SESI14	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)	NON	OUI
SESI15	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)		
SESI16	Taux d'intérêt actuel sur les dépôts en espèces	Lorsque le type de sûreté consiste en des dépôts en espèces, entrer le taux d'intérêt actuel sur ces dépôts. En cas de comptes de dépôt multiples par devise, entrer le taux d'intérêt actuel moyen pondéré, en utilisant comme facteur de pondération le solde actuel des dépôts en espèce dans les comptes respectifs.	NON	OUI
SESI17	Nom de la contrepartie à l'accord de mise en pension	Si la sûreté spécifique fait partie d'une mise en pension, indiquer la dénomination sociale complète de la contrepartie à la titrisation. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
SESI18	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie à l'accord de mise en pension	Si la sûreté spécifique fait partie d'une mise en pension, indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de la contrepartie où les espèces sont déposés.	NON	OUI
SESI19	Date d'échéance de l'accord de mise en pension	Si la sûreté spécifique fait partie d'une mise en pension, indiquer la date d'échéance de la titrisation.	NON	OUI
Autres informations				
SESO1	Identifiant unique	Identifiant unique entré dans le champ SESS1.	NON	NON
SESO2	Numéro de ligne des autres informations	Entrer le numéro de ligne des autres informations.	NON	NON
SESO3	Autres informations	Autres informations, ligne par ligne.	NON	NON

▼ B

ANNEXE XV

▼ C1INFORMATIONS PRIVILÉGIÉES OU INFORMATIONS SUR LES ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS —
TITRISATION ABCP▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
Informations sur le programme				
SEAS1	Identifiant unique – Programme ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante au programme ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
SEAS2	Date d'arrêté des données	Date d'arrêté des données pour la présente communication de données. Lorsqu'elle est présentée en même temps que la communication des données sur les expositions sous-jacentes et les rapports destinés aux investisseurs, cette date doit correspondre à la date d'arrêté des données figurant dans les modèles applicables présentés pour les expositions sous-jacentes et les rapports destinés aux investisseurs.	NON	NON
SEAS3	À cessé d'être STS	Le programme ABCP a-t-il cessé d'être conforme aux exigences STS? Si le programme ABCP n'a jamais eu le statut STS, entrer ND5.	NON	OUI
SEAS4	Mesures correctives	Les autorités compétentes ont-elles pris des mesures correctives concernant cette titrisation? Si la titrisation n'est pas une titrisation STS, entrer ND5.	NON	OUI
SEAS5	Mesures administratives	Les autorités compétentes ont-elles pris des mesures administratives à l'égard de cette titrisation? Si la titrisation n'est pas une titrisation STS, entrer ND5.	NON	OUI
SEAS6	Modification significative des documents concernant l'opération	Décrire toute modification significative des documents concernant l'opération, en incluant le nom et le code (conformément au tableau 3 de l'annexe I) du document ainsi qu'une description détaillée des modifications.	NON	OUI
SEAS7	Droit applicable	Juridiction régissant le programme.	NON	NON
SEAS8	Durée de la facilité de trésorerie	Période durant laquelle la facilité de trésorerie au niveau du programme fournit une couverture au programme (en jours).	NON	OUI
SEAS9	Couverture de la facilité de trésorerie	Montant de financement maximal (en pourcentage d'expositions sous-jacentes du programme) couvert par la facilité de trésorerie concernée au niveau du programme.	NON	OUI
SEAS10	Intervalle de la facilité de trésorerie	Nombre maximal de jours d'intervalle avant que la facilité de trésorerie au niveau du programme ne commence à financer l'opération, à la suite d'un événement déclenchant les versements de la facilité de trésorerie.	NON	OUI
SEAS11	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	Date à laquelle prendra fin la facilité de trésorerie au niveau du programme.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAS12	Prélèvements sur la facilité de trésorerie	Si la titrisation prévoit une facilité de trésorerie au niveau du programme, confirmer s'il y a eu ou non un prélèvement sur la facilité de trésorerie au cours de la période se terminant à la date du dernier versement des intérêts.	NON	OUI
SEAS13	Émissions totales	Encours total des émissions du programme, converti en EUR. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEAS14	Émissions maximales	Si une limite s'applique à tout moment au montant des émissions du programme ABCP, entrer cette limite ici. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

Informations sur l'opération

SEAR1	Identifiant unique – Programme ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de programme ABCP que celui entré dans le champ SEAS1.	NON	NON
SEAR2	Identifiant unique – Opération ABCP	Identifiant unique attribué par l'entité déclarante à cette opération ABCP conformément à l'article 11, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224.	NON	NON
SEAR3	Nombre de programmes finançant l'opération	Nombre de programmes ABCP financés par cette opération.	NON	NON
SEAR4	À cessé d'être STS	L'opération ABCP a-t-elle cessé d'être conforme aux exigences STS? Si l'opération ABCP n'a jamais eu le statut STS, entrer ND5.	NON	OUI
SEAR5	Initiateur client du sponsor du programme	L'initiateur a-t-il été, au moment du transfert des actifs, client du sponsor du programme?	NON	NON
SEAR6	Sûreté accordée	La SSPE/filiale de l'initiateur jouissant d'une réelle autonomie patrimoniale a-t-il/elle accordé à l'acheteur une sûreté sur ces actifs (SSPE)?	NON	NON
SEAR7	Revenus	Total des revenus de l'initiateur pour la période couverte par le compte d'exploitation financier le plus récent (c'est-à-dire depuis le début de l'année ou les 12 derniers mois). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAR8	Charges d'exploitation	Total des charges d'exploitation de l'initiateur fournies par le compte d'exploitation financier le plus récent (c'est-à-dire depuis le début de l'année ou les 12 derniers mois). Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR9	Actifs actuels	Actifs actuels de l'initiateur (arrivant à échéance dans les 12 prochains mois ou conformément à la norme comptable applicable), à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR10	Espèces	Actifs en espèces de l'initiateur, à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR11	Titres négociables	Titres négociables de l'initiateur, à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR12	Créances	Créances de l'initiateur, à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR13	Passifs actuels	Passifs actuels de l'initiateur (dus dans les 12 prochains mois ou conformément à la norme comptable applicable), à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR14	Total des dettes	Total des dettes de l'initiateur, à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR15	Total des capitaux propres	Total des capitaux propres de l'initiateur, à la date du compte d'exploitation financier le plus récent. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAR16	Monnaie d'établissement des états financiers	Devise utilisée dans les informations financières des champs SEAR7 à SEAR15.	NON	OUI
SEAR17	Le sponsor soutient l'opération	À quel niveau le sponsor fournit-il un soutien: Au niveau de l'opération (TRXN) Au niveau du programme (PRGM) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEAR18	Type de soutien du sponsor	Le sponsor fournit-il un soutien complet à cette opération?	NON	OUI
SEAR19	Durée de la facilité de trésorerie	Période durant laquelle la facilité de trésorerie au niveau de l'opération fournit une couverture à l'opération (en jours).	NON	OUI
SEAR20	Montant prélevé sur la facilité de trésorerie	Montant prélevé sur le contrat de trésorerie entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de la présente communication de données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR21	Couverture de la facilité de trésorerie	Montant de financement maximal (en pourcentage d'expositions sous-jacentes de l'opération) couvert par la facilité de trésorerie concernée au niveau de l'opération.	NON	OUI
SEAR22	Intervalle de la facilité de trésorerie	Nombre maximal de jours d'intervalle avant que la facilité de trésorerie ne commence à financer l'opération, à la suite d'un événement déclenchant les versements de la facilité de trésorerie.	NON	OUI
SEAR23	Type de facilité de trésorerie	Type de facilité de trésorerie au niveau de l'opération: Achat d'actifs (ASPR) Mise en pension (RPAG) Facilité de prêt (LOFA) Contrat de participation (PAGR) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEAR24	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	Si la facilité de trésorerie au niveau de l'opération utilise une mise en pension, entrer la date à laquelle prendra fin la mise en pension.	NON	OUI
SEAR25	Monnaie de la facilité de trésorerie	Devise dans laquelle les fonds provenant de la facilité de trésorerie au niveau de l'opération peuvent être prélevés.	NON	OUI
SEAR26	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	Date à laquelle prendra fin la facilité de trésorerie au niveau de l'opération.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAR27	Nom du fournisseur de la facilité de trésorerie	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur de la facilité de trésorerie au niveau de l'opération. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
SEAR28	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de la facilité de trésorerie	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur de la facilité de trésorerie au niveau de l'opération.	NON	OUI
SEAR29	Surcollatéralisation/ Intérêt subordonné	Pourcentage d'intérêt subordonné conservé dans les expositions sous-jacentes vendues par le vendeur (sinon: remise accordée par le vendeur sur le prix d'achat des expositions sous-jacentes). Lorsque le pourcentage d'intérêt subordonné varie entre les expositions sous-jacentes, la surcollatéralisation minimale pour toutes les expositions sous-jacentes doit être indiquée.	NON	NON
SEAR30	Marge excédentaire de l'opération	Montant des fonds restants après application de tous les paiements, coûts, commissions, etc., actuellement applicables, communément désignés en tant que «marge excédentaire». Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEAR31	Nom du fournisseur de la lettre de crédit	Entrer la dénomination sociale complète du fournisseur de la lettre de crédit. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
SEAR32	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de la lettre de crédit	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du fournisseur de la lettre de crédit.	NON	OUI
SEAR33	Monnaie de la lettre de crédit	Libellé de la devise de la lettre de crédit.	NON	OUI
SEAR34	Protection maximale de la lettre de crédit	Montant maximal de couverture, en pourcentage d'expositions sous-jacentes de l'opération, au titre du contrat de protection de la lettre de crédit.	NON	OUI
SEAR35	Nom du garant	Entrer la dénomination sociale complète du garant (y compris les arrangements en vertu desquels un établissement s'engage à acheter des créances en défaut auprès du vendeur). La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	OUI
SEAR36	Identifiant d'entité juridique du garant	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] du garant (y compris les arrangements en vertu desquels un établissement s'engage à acheter des créances en défaut auprès du vendeur).	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAR37	Couverture maximale de la garantie	Montant maximal de la couverture au titre de la garantie/ contrat d'achat. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR38	Monnaie de la garantie	Devise dans laquelle les fonds provenant de la garantie sont fournis.	NON	OUI
SEAR39	Date d'échéance de la garantie	Date à laquelle prendra fin la garantie.	NON	OUI
SEAR40	Type de transfert des créances	Comment le transfert des expositions sous-jacentes à l'acheteur a-t-il été réalisé? Cession parfaite (1) Prêt garanti (2) Autre (3)	NON	NON
SEAR41	Date d'échéance de l'accord de mise en pension	Date à laquelle prendra fin toute mise en pension régissant le transfert des expositions sous-jacentes à l'acheteur.	NON	OUI
SEAR42	Montant acheté	Montant des expositions sous-jacentes achetées auprès de l'initiateur dans le cadre de cette opération entre la précédente date d'arrêt des données et la date d'arrêt des données de la présente communication de données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEAR43	Limite maximale de financement	Limite maximale de financement qui peut être fourni par l'initiateur dans le cadre de l'opération, à la date d'arrêt des données. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAR44	Indice de référence du swap de taux d'intérêt	Décrire le type de l'indice de référence du swap de taux d'intérêt sur lequel la jambe payeuse du swap est fixée. En cas de swaps multiples dans cette opération, il doit s'agir du type du swap de taux d'intérêt le plus récent conclu. MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
SEAR45	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt au niveau de l'opération. En cas de swaps multiples dans cette opération, entrer la date d'échéance du swap le plus récent.	NON	OUI
SEAR46	Notionnel du swap de taux d'intérêt	Montant notionnel du swap de taux d'intérêt au niveau de l'opération. En cas de swaps multiples dans cette opération, entrer le notionnel du swap le plus récent.	NON	OUI
SEAR47	Monnaie du payeur du swap de devises	Entrer la devise dans laquelle la jambe payeuse du swap effectue les paiements. En cas de swaps multiples dans cette opération, il doit s'agir du type du swap de devises le plus récent conclu.	NON	OUI
SEAR48	Monnaie du receveur du swap de devises	Entrer la devise dans laquelle la jambe receveuse du swap effectue les paiements. En cas de swaps multiples dans cette opération, il doit s'agir du type du swap de devises le plus récent conclu.	NON	OUI

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAR49	Taux de change pour swap de devises	Taux de change ayant été fixé pour un swap de devises au niveau de l'opération. En cas de swaps multiples dans cette opération, entrer le taux de change fixé pour le swap le plus récent.	NON	OUI
SEAR50	Date d'échéance du swap de devises	Date d'échéance du swap de devises au niveau de l'opération. En cas de swaps multiples dans cette opération, entrer la date d'échéance du swap le plus récent conclu.	NON	OUI
SEAR51	Notionnel du swap de devises	Montant notionnel du swap de devises au niveau de l'opération. En cas de swaps multiples dans cette opération, entrer le montant couvert par le swap le plus récent conclu. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI

Informations au niveau des tranches/obligations

SEAT1	Identifiant unique – Programme ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de programme ABCP que celui entré dans le champ SEAS1.	NON	NON
SEAT2	Identifiant initial de l'obligation	Identifiant unique initial attribué à cet instrument. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEAT3	Nouvel identifiant de l'obligation	Si l'identifiant initial dans le champ SEAT2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer la valeur dans le champ SEAT2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEAT4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	Code ISIN attribué à cet instrument, le cas échéant.	NON	OUI
SEAT5	Type de tranche/ d'obligation	Sélectionner l'option la plus appropriée pour décrire le profil de remboursement de l'instrument: Hard bullet (à savoir, date d'échéance fixe) (HBUL) Soft bullet (à savoir, la date d'échéance prévue peut-être reportée à la date d'échéance légale) (SBUL) Amortissement prévu (à savoir, remboursement du principal aux dates d'amortissement prévues) (SAMO) Amortissement contrôlé (à savoir, le remboursement du principal débute à une période déterminée) (CAMM) Autre (OTHR)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAT6	Date d'émission	Date à laquelle cet instrument a été émis.	NON	NON
SEAT7	Date d'échéance légale	Date avant laquelle cet instrument doit être remboursé pour ne pas être en défaut.	NON	OUI
SEAT8	Monnaie	Monnaie dans laquelle est libellé l'instrument.	NON	NON
SEAT9	Encours actuel du capital	Montant au pair ou notionnel de l'encours de cet instrument après la date de versement du capital actuel. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEAT10	Coupon actuel	Coupon de l'instrument en points de base.	NON	NON
SEAT11	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	Indice de référence du taux d'intérêt actuellement applicable (le taux de référence sur la base duquel le taux d'intérêt est fixé): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO)	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Taux de base de la Banque d'Angleterre (BOER) Taux de base de la Banque centrale européenne (ECBR) Taux du prêteur (LDOR) Autre (OTHR)		
SEAT12	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel: Au jour le jour (OVNG) Intrajournalier (INDA) 1 jour (DAIL) 1 semaine (WEEK) 2 semaines (WEEK) 1 mois (MNTH) 2 mois (TOMN) 3 mois (QUTR) 4 mois (FOMN) 6 mois (SEMI) 12 mois (YEAR) Sur demande (ONDE) Autre (OTHR)	NON	OUI
SEAT13	Périodicité de paiement des intérêts	Périodicité à laquelle il est prévu que les intérêts soient versés sur cet instrument: Mensuel (MNTH) Trimestriel (QUTR) Semestriel (SEMI) Annuel (YEAR) Autre (OTHR)	NON	NON
SEAT14	Rehaussement de crédit actuel	Rehaussement de crédit actuel de l'instrument, calculé conformément à la définition de l'initiateur/du sponsor/ de la SSPE.	NON	NON
SEAT15	Formule de rehaussement de crédit	Décrire/entrer la formule utilisée pour calculer le rehaussement de crédit au niveau de l'obligation.	NON	OUI

Informations au niveau du compte

SEAA1	Identifiant unique – Opération ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de l'opération ABCP que celui entré dans le champ SEAR2.	NON	NON
-------	-------------------------------------	--	-----	-----

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAA2	Identifiant initial du compte	Identifiant unique initial du compte. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEAA3	Nouvel identifiant du compte	Si l'identifiant initial dans le champ SEAA2 ne peut pas être maintenu dans ce champ, entrer le nouvel identifiant ici. Si l'identifiant n'a pas été modifié, entrer le même identifiant que dans le champ SEAA2. L'entité déclarante ne doit pas modifier cet identifiant unique.	NON	NON
SEAA4	Type de compte	Type du compte: Compte de trésorerie (CARE) Compte commun (CORE) Compte de compensation (SORE) Facilité de trésorerie (LQDF) Compte de marge (MGAC) Autre compte (OTHR)	NON	NON
SEAA5	Solde cible du compte	Montant des fonds qui sont en dépôt sur le compte concerné lorsqu'il est entièrement financé, conformément à la documentation de la titrisation. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	OUI
SEAA6	Solde effectif du compte	Solde des fonds en dépôt sur le compte concerné à la date de fin du cumul. Inclure la devise dans laquelle est libellé le montant, en utilisant le format {CURRENCYCODE_3}.	NON	NON
SEAA7	Amortissement du compte	Le compte est-il amorti tout au long de la durée de vie de la titrisation?	NON	NON

Informations au niveau de la contrepartie

SEAP1	Identifiant unique – Opération ABCP	Indiquer ici le même identifiant unique de l'opération ABCP que celui entré dans le champ SEAR2.	NON	NON
SEAP2	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie	Indiquer l'identifiant d'entité juridique [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] de la contrepartie.	NON	NON
SEAP3	Nom de la contrepartie	Indiquer la dénomination sociale complète de la contrepartie. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF).	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAP4	Type de contrepartie	Type de contrepartie: Banque du compte (ABNK) Banque du compte de secours (BABN) Facilitateur de la banque du compte (ABFC) Garant de la banque du compte (ABGR) Agent des garanties (CAGT) Agent des paiements (PAYA) Agent de calcul (CALC) Agent administratif (AMDI) Sous-agent administratif (ADSA) Agent de transfert (RANA) Agent de vérification (VERI) Agent des sûretés (SECU) Fournisseur d'avance de trésorerie (CAPR) Fournisseur de sûretés réelles (COLL) Fournisseur de contrats d'investissement garanti (GICP) Fournisseur d'assurance-crédit (IPCP) Fournisseur de facilités de trésorerie (LQFP) Fournisseur de facilités de trésorerie de secours (BLQP) Participant à un prêt hypothécaire sur épargne (SVMP) Émetteur (ISSR) Initiateur (ORIG) Vendeur (SELL) Sponsor de l'entité de titrisation (SSSP) Organe de gestion (SERV) Organe de gestion de secours Facilitateur de l'organe de gestion de secours (BSRF) Organe de gestion spécial (SSRV) Souscripteur (SUBS) Fournisseur de swap de taux d'intérêt (IRSP) Fournisseur de swap de taux d'intérêt de secours (BIPR) Fournisseur de swap de devises (CSPR) Fournisseur de swap de devises de secours (BCSP) Auditeur (AUDT) Conseiller (CNLS) Mandataire (TRUS) Représentant des porteurs de titres (REPN)	NON	NON

▼ B

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
		Preneur ferme (UNDR) Arrangeur (ARRG) Négociant (DEAL) Gestionnaire (MNGR) Fournisseur de lettres de crédit (LCPR) Conduit Multi-Cédant (MSCD) Entité de titrisation (SSPE) Agent de liquidité ou de liquidation (LQAG) Actionnaire du conduit/SSPE (EQOC) Fournisseur de facilité de tirage en valeur jour (LQFP) Fournisseur de prêts ou de contrats de location pour start-ups (SULP) Contrepartie à la mise en pension (RAGC) Gestionnaire de trésorerie (CASM) Banque du compte d'encaissement (BABN) Banque du compte de la sûreté (BABN) Fournisseur de prêt subordonné (SBLP) Gestionnaire de titres adossés à des prêts aux entreprises (CLOM) Conseiller du portefeuille (PRTA) Agent de substitution (SUBA) Autre (OTHR)		
SEAP5	Pays d'établissement de la contrepartie	Pays dans lequel est établie la contrepartie.	NON	NON
SEAP6	Seuil de notation de la contrepartie	Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer le seuil de notation de la contrepartie à la date d'arrêté des données. En cas de notations multiples, toutes les notations doivent être indiquées conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.	NON	OUI
SEAP7	Notation de la contrepartie	Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer la note de la contrepartie à la date d'arrêté des données. En cas de seuils de notation multiples, tous les seuils de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.	NON	OUI

▼ **B**

Code du champ	Nom du champ	Contenu à déclarer	ND1-ND4 autorisé?	ND5 autorisé?
SEAP8	Identifiant d'entité juridique de la source de la notation de la contrepartie	Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer l'identifiant d'entité juridique du fournisseur de la notation de la contrepartie [tel que spécifié dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF)] à la date d'arrêt des données. En cas de notations multiples, tous les identifiants des fournisseurs de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.	NON	OUI
SEAP9	Nom de la source de la notation de la contrepartie	Si un seuil fondé sur des notations est précisé pour le service fourni par cette contrepartie dans la titrisation, entrer le nom complet du fournisseur de la notation de la contrepartie à la date d'arrêt des données. La dénomination entrée doit correspondre à la dénomination associée au LEI dans la base de données de la Global Legal Entity Foundation (GLEIF). En cas de notations multiples, tous les identifiants des fournisseurs de notation doivent être indiqués conformément au schéma XML. S'il n'y a pas de seuil fondé sur des notations, entrer ND5.	NON	OUI

Autres informations

SEAO1	Identifiant unique	Identifiant unique entré dans le champ SEAS1.	NON	NON
SEAO2	Numéro de ligne des autres informations	Entrer le numéro de ligne des autres informations.	NON	NON
SEAO3	Autres informations	Autres informations, ligne par ligne.	NON	NON