

**RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2019/363 DE LA COMMISSION****du 13 décembre 2018****définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations des éléments des opérations de financement sur titres aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil, et modifiant le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission en ce qui concerne les codes utilisés pour la déclaration des contrats dérivés****(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)**

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2015 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 <sup>(1)</sup>, et notamment son article 4, paragraphe 10,

vu le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux <sup>(2)</sup>, et notamment son article 9, paragraphe 6,

considérant ce qui suit:

- (1) Les éléments que les contreparties aux opérations de financement sur titres (ci-après les «OFT») déclarent aux référentiels centraux ou à l'Autorité européenne des marchés financiers (ci-après l'«AEMF») devraient être présentés dans un format harmonisé afin de faciliter la collecte, l'agrégation et la comparaison des données entre les référentiels centraux. Pour limiter les coûts supportés par les contreparties déclarantes, le format de déclaration des OFT devrait, dans la mesure du possible, être en adéquation avec celui prescrit pour la déclaration des contrats dérivés imposée par l'article 9 du règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil. Le présent règlement établit donc le format à utiliser pour chacun des champs à compléter et normalise la déclaration par référence à une norme ISO largement utilisée dans le secteur financier.
- (2) Le système international d'identifiants d'entités juridiques (*Legal Entity Identifier*, ci-après «LEI») étant à présent pleinement opérationnel, les contreparties à une OFT devraient utiliser exclusivement celui-ci pour identifier une entité juridique dans une déclaration. Pour que l'utilisation du système LEI par une contrepartie soit efficace, cette dernière devrait veiller à ce que les données de référence liées à son LEI soient renouvelées conformément aux conditions d'un émetteur de LEI accrédité (unité opérationnelle locale ou «*Local Operating Unit*»). Une extension du système LEI international (*Global LEI System*) à l'identification des succursales des entités juridiques est actuellement en cours d'élaboration. En attendant que cette extension soit finalisée et considérée comme adéquate aux fins de la déclaration des OFT et que le présent règlement soit modifié en conséquence, il convient, lorsqu'une OFT est conclue par l'intermédiaire d'une succursale d'une contrepartie, d'utiliser pour identifier ladite succursale le code ISO du pays dans lequel celle-ci est située.
- (3) Un système international d'identifiants de transaction uniques (*Unique Trade Identifier*, ci-après «UTI») permettant d'identifier les OFT est également en cours d'élaboration. En attendant que ce système UTI international soit finalisé et considéré comme adéquat aux fins de la déclaration des OFT et que le présent règlement soit modifié en conséquence, l'identification d'une OFT devrait se faire au moyen d'un UTI dont les contreparties ont convenu.
- (4) L'article 4 bis du règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission <sup>(3)</sup> prévoit une procédure pour déterminer à quelle entité il incombe de générer l'identifiant de transaction unique pour la déclaration des contrats dérivés lorsque les contreparties ne parviennent pas à s'accorder à cet égard. Afin d'harmoniser la déclaration des contrats dérivés et celle des OFT, une procédure similaire devrait être mise en place pour les contreparties qui déclarent des OFT.

<sup>(1)</sup> JO L 337 du 23.12.2015, p. 1.

<sup>(2)</sup> JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.

<sup>(3)</sup> Règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission du 19 décembre 2012 définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations de transactions aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux (JO L 352 du 21.12.2012, p. 20).

- (5) À l'heure actuelle, il n'existe pas de pratiques communes du marché lorsqu'il s'agit de déterminer de quel côté se situe une contrepartie dans une OFT. Il convient donc d'établir des règles spécifiques pour garantir que la partie qui fournit des sûretés (*collateral*) dans une OFT et celle qui les reçoit sont identifiées de manière exacte et uniforme.
- (6) Plusieurs déclarations peuvent être déposées pour une même OFT, par exemple si plusieurs modifications successives sont apportées à cette dernière. Pour permettre une bonne compréhension de chaque déclaration relative à une OFT, et de chaque OFT dans son ensemble, les déclarations devraient être déposées dans l'ordre chronologique dans lequel les événements déclarés se sont produits.
- (7) Afin d'alléger la charge de déclarer la modification de certaines valeurs, et notamment des éléments relatifs à la valeur des sûretés, à la marge apportée ou reçue et à la réutilisation des sûretés, ces éléments ne devraient être déclarés tels qu'actualisés à la fin de chaque journée que s'ils ont changé par rapport à ce qui avait été déclaré précédemment.
- (8) Les éléments relatifs à un encours de prêt avec appel de marge devraient être déclarés tels qu'actualisés à la fin de chaque journée en cas de débit net en espèces dans la monnaie principale ou lorsque la valeur de marché des positions courtes de la contrepartie est positive.
- (9) La valeur de marché des titres prêtés ou empruntés devrait être déclarée telle qu'actualisée à la fin de chaque journée. De même, lorsque les contreparties déclarent la valeur de marché des sûretés, elles devraient la déclarer telle qu'actualisée à la fin de chaque journée.
- (10) Le présent règlement est fondé sur les projets de normes techniques d'exécution soumis par l'AEMF à la Commission conformément à la procédure prévue à l'article 15 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers) <sup>(4)</sup>.
- (11) L'AEMF a mené des consultations publiques ouvertes sur ces projets de normes techniques d'exécution, analysé les coûts et avantages potentiels qu'elles impliquent et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010.
- (12) Comme c'est le cas pour la déclaration des OFT, certains identifiants et codes à utiliser pour la déclaration des contrats dérivés sont encore en cours d'élaboration. En attendant que ces identifiants et codes soient disponibles et considérés comme adéquats aux fins de la déclaration des contrats dérivés et que le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 ait été modifié en conséquence, ce dernier règlement prévoit l'utilisation d'un code CFI ISO 10692 pour la classification des dérivés pour lesquels ni un code ISIN ISO 6166 ni un code AII n'est disponible, ainsi que l'utilisation d'un identifiant de transaction unique convenu par les contreparties pour l'identification d'une déclaration de contrat dérivé. Afin de garantir la sécurité juridique en ce qui concerne la procédure appropriée de modification des exigences applicables à la déclaration des contrats dérivés, et pour assurer le degré nécessaire de cohérence entre la déclaration des contrats dérivés et la déclaration des OFT, le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 ne devrait faire référence qu'aux exigences actuellement applicables à la déclaration des contrats dérivés.
- (13) Il y a donc lieu de modifier le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 en conséquence,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

#### *Article premier*

### **Normes et formats des données pour la déclaration des éléments des opérations de financement sur titres**

Les éléments d'une opération de financement sur titres dans une déclaration soumise en application de l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) 2015/2365 sont présentés conformément aux normes et aux formats indiqués dans les tableaux 1 à 5 de l'annexe I. Cette déclaration est fournie sous une forme électronique commune lisible par machine et selon un modèle XML commun conforme à la méthodologie ISO 20022.

<sup>(4)</sup> JO L 331 du 15.12.2010, p. 84.

*Article 2***Identification des contreparties et des autres entités**

1. Dans la déclaration visée à l'article 1<sup>er</sup>, un code d'identifiant d'entité juridique (ci-après «LEI») ISO 17442 est utilisé pour identifier:
  - a) un bénéficiaire qui est une entité juridique;
  - b) une entité de courtage;
  - c) une contrepartie centrale agréée conformément au règlement (UE) n° 648/2012;
  - d) un membre compensateur;
  - e) un agent prêteur;
  - f) un participant à un dépositaire central de titres;
  - g) une contrepartie qui est une entité juridique;
  - h) un agent tripartite;
  - i) une entité soumettant une déclaration;
  - j) l'émetteur d'un titre qui a été prêté, emprunté ou fourni comme sûreté dans le cadre d'une opération de financement sur titres.
2. Une contrepartie à une opération de financement sur titres veille à ce que les données de référence liées à son code LEI ISO 17442 soient renouvelées conformément aux conditions de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système d'identifiant international pour les entités juridiques (*Global LEI System*).
3. Lorsqu'une opération de financement sur titres est conclue par l'intermédiaire d'une succursale d'une contrepartie, le code indiqué dans le champ 7 et dans le champ 8 du tableau 1 de l'annexe I est utilisé dans la déclaration visée à l'article 1<sup>er</sup> pour identifier cette succursale de la contrepartie.

*Article 3***Identifiant de transaction unique**

1. Une déclaration est identifiée au moyen d'un identifiant de transaction unique (ci-après «UTI») convenu par les contreparties conformément au format indiqué dans le champ 1 du tableau 2 de l'annexe I.
2. Lorsqu'elles ne s'accordent pas sur l'entité à qui il incombe de générer l'UTI à assigner à la déclaration, les contreparties déterminent ladite entité conformément aux principes suivants:
  - a) pour les opérations de financement sur titres faisant l'objet d'une exécution et d'une compensation centralisées, l'UTI est généré par la contrepartie centrale pour le membre compensateur au point de compensation. Un autre UTI est généré par le membre compensateur pour sa contrepartie;
  - b) pour les opérations de financement sur titres faisant l'objet d'une exécution centralisée, mais non d'une compensation centralisée, l'UTI est généré par la plateforme de négociation où a lieu l'exécution pour son membre;
  - c) pour les opérations de financement sur titres faisant l'objet d'une confirmation et d'une compensation centralisées, l'UTI est généré par la contrepartie centrale pour le membre compensateur au point de compensation. Un autre UTI est généré par le membre compensateur pour sa contrepartie;
  - d) pour les opérations de financement sur titres qui ont été confirmées de manière centralisée par voie électronique, mais qui n'ont pas fait l'objet d'une compensation centralisée, l'UTI est généré par la plateforme de confirmation des transactions au point de confirmation;
  - e) pour toutes les opérations de financement sur titres autres que celles visées aux points a) à d), les dispositions suivantes s'appliquent:
    - i) lorsque des contreparties financières concluent une opération de financement sur titres avec des contreparties non financières, l'UTI est généré par les contreparties financières;
    - ii) pour toutes les opérations de prêt ou d'emprunt de titres autres que celles visées au point i), l'UTI est généré par le fournisseur de sûretés tel que visé à l'article 4;

iii) pour toutes les opérations de financement sur titres autres que celles visées aux points i) et ii), l'UTI est généré par le preneur de sûretés tel que visé à l'article 4.

3. La contrepartie qui génère l'UTI communique cet UTI à l'autre contrepartie dans un délai suffisamment court pour permettre à cette dernière de s'acquitter de son obligation de déclaration.

#### Article 4

##### **Côté de la contrepartie**

1. Le côté de la contrepartie à l'opération de financement sur titres visé dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I est déterminé conformément aux paragraphes 2 à 4.

2. Dans le cas d'opérations de pension, d'opérations d'achat-revente ou d'opérations de vente-rachat, la contrepartie qui achète les titres, les matières premières, ou les droits garantis relatifs à la propriété de titres ou de matières première dans le cadre du premier volet, ou volet comptant, de la transaction et qui s'engage à les revendre à un prix convenu à une date ultérieure dans le cadre du deuxième volet, ou volet à terme, de la transaction est identifiée en tant que preneur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I. La contrepartie qui vend ces titres, ces matières premières ou ces droits garantis est identifiée en tant que fournisseur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I.

3. Dans le cas de d'opérations d'emprunt de titres ou de matières premières ou d'opérations de prêt de titres ou de matières premières, la contrepartie qui prête les titres ou les matières premières à la condition que l'emprunteur lui restitue des titres ou des matières premières équivalents à une date future ou lorsque la contrepartie qui transfère les titres ou les matières premières le lui demandera est identifiée en tant que preneur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I. La contrepartie qui emprunte ces titres ou ces matières premières est identifiée en tant que fournisseur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I.

4. Dans le cas d'opérations de prêt avec appel de marge, l'emprunteur, c'est-à-dire la contrepartie à qui le crédit est octroyé en échange de sûretés, est identifié en tant que fournisseur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I. Le prêteur, c'est-à-dire la contrepartie qui octroie le crédit en échange de sûretés, est identifié en tant que preneur de sûretés dans le champ 9 du tableau 1 de l'annexe I.

#### Article 5

##### **Fréquence des déclarations des éléments des opérations de financement sur titres**

1. Toutes les déclarations des éléments d'une opération de financement sur titres visés à l'article 1<sup>er</sup>, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2019/356 de la Commission <sup>(<sup>7</sup>)</sup> sont déposées dans l'ordre chronologique dans lequel les événements déclarés se sont produits.

2. Une contrepartie à une opération de prêt avec appel de marge déclare les éléments du prêt avec appel de marge en cours tels qu'actualisés à la fin de chaque journée en cas de débit net en espèces dans la monnaie principale ou lorsque la valeur de marché de ses positions courtes est positive.

3. Une contrepartie à une opération de financement sur titres en cours déclare, dans les champs 75 à 94 du tableau 2 de l'annexe I, toute modification des éléments relatifs aux sûretés en mentionnant le type d'action «actualisation des sûretés». La contrepartie déclare ces éléments modifiés tels qu'actualisés à la fin de chaque journée jusqu'à ce qu'elle déclare la cessation de l'opération de financement sur titres, ou qu'elle déclare l'opération de financement sur titres en mentionnant le type d'action «Erreur», ou jusqu'à ce que l'opération de financement sur titres atteigne sa date d'échéance, la date la plus proche étant retenue.

4. Une contrepartie à une opération de financement sur titres en cours déclare, dans le champ 57 du tableau 2 de l'annexe I, toute modification du cours de clôture des titres prêtés ou empruntés en mentionnant le type d'action «actualisation de la valorisation». La contrepartie déclare cette valeur de marché modifiée telle qu'actualisée à la fin de chaque journée jusqu'à ce qu'elle déclare la cessation de l'opération de financement sur titres, ou qu'elle déclare l'opération de financement sur titres en mentionnant le type d'action «Erreur», ou jusqu'à ce que l'opération de financement sur titres atteigne sa date d'échéance.

<sup>(7)</sup> Règlement délégué (UE) 2019/356 de la Commission du 13 décembre 2018 complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les éléments des opérations de financement sur titres à déclarer à un référentiel central (voir page 1 du présent Journal officiel).

5. Une contrepartie déclare, dans les champs 8 à 19 du tableau 3 de l'annexe I, toute modification du montant total des marges apportées ou reçues pour toutes les opérations de financement sur titres compensées tel qu'actualisé à la fin de la journée en mentionnant le type d'action «Actualisation des marges», après avoir d'abord déclaré le montant total des marges apportées ou reçues en mentionnant le type d'action «Nouveau».

6. Une contrepartie déclare, dans les champs 8 à 14 du tableau 4 de l'annexe I, toute modification de la valeur des sûretés réutilisées, des espèces réinvesties et des sources de financement telle qu'actualisée à la fin de la journée en mentionnant le type d'action «Actualisation de la réutilisation», après avoir déclaré les valeurs correspondantes en mentionnant le type d'action «Nouveau».

#### Article 6

### Modifications du règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012

Le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 est modifié comme suit:

1) l'article 4 est modifié comme suit:

a) le paragraphe 7 est remplacé par le texte suivant:

«Les produits dérivés sont classés dans le champ 4 du tableau 2 de l'annexe selon un code de classification des instruments financiers (code CFI) ISO 10692.»;

b) les paragraphes 8 et 9 sont supprimés;

2) à l'article 4 bis, le paragraphe 1 est remplacé par le texte suivant:

«1. Les déclarations sont identifiées au moyen d'un identifiant de transaction unique convenu par les contreparties.»;

3) l'annexe est remplacée par le texte figurant à l'annexe II du présent règlement.

#### Article 7

### 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.

Fait à Bruxelles, le 13 décembre 2018.

Par la Commission  
Le président  
Jean-Claude JUNCKER

## ANNEXE I

**Formats à utiliser pour déclarer les éléments des opérations de financement sur titres, comme visé à l'article 4, paragraphes 1 et 5, du règlement (UE) 2015/2365**

Tableau 1

**Données sur les contreparties**

N°	Champ	Format
1	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
2	Entité qui soumet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
3	Contrepartie déclarante	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
4	Nature de la contrepartie déclarante	«F» = contrepartie financière «N» = contrepartie non financière
5	Secteur de la contrepartie déclarante	<p>Taxinomie des contreparties financières:</p> <p>«CDTI» – un établissement de crédit agréé conformément à la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil <sup>(1)</sup> ou au règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil <sup>(2)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à l'un de ces actes législatifs</p> <p>«INVF» – une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil <sup>(3)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«INUN» – une entreprise d'assurance agréée conformément à la directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(4)</sup> (Solvabilité II), ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«AIFD» – un FIA géré par un gestionnaire de FIA agréé ou enregistré conformément à la directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil <sup>(5)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«ORPI» – une institution de retraite professionnelle agréée ou inscrite dans un registre conformément à la directive 2003/41/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(6)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«CCPS» – une contrepartie centrale agréée conformément au règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil <sup>(7)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«REIN» – une entreprise de réassurance agréée conformément à la directive Solvabilité II, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«CSDS» – un dépositaire central de titres agréé conformément au règlement (UE) n° 909/2014 du Parlement européen et du Conseil <sup>(8)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p> <p>«UCIT» – un OPCVM et sa société de gestion agréés conformément à la directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(9)</sup>, ou une entité d'un pays tiers qui devrait faire l'objet d'un agrément ou d'un enregistrement conformément à cet acte législatif</p>

N°	Champ	Format
		Taxinomie des contreparties non financières. Les catégories ci-dessous correspondent aux principales sections de la nomenclature NACE, telle que définie dans le règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil <sup>(10)</sup> «A» – Agriculture, sylviculture et pêche «B» – Industries extractives «C» – Industrie manufacturière «D» – Production et distribution d'électricité, de gaz, de vapeur et d'air conditionné «E» – Production et distribution d'eau; assainissement, gestion des déchets et dépollution «F» – Construction «G» – Commerce; réparation d'automobiles et de motocycles «H» – Transports et entreposage «I» – Hébergement et restauration «J» – Information et communication «K» – Activités financières et d'assurance «L» – Activités immobilières «M» – Activités spécialisées, scientifiques et techniques «N» – Activités de services administratifs et de soutien «O» – Administration publique et défense; sécurité sociale obligatoire «P» – Enseignement «Q» – Santé humaine et action sociale «R» – Arts, spectacles et activités récréatives «S» – Autres activités de services «T» – Activités des ménages en tant qu'employeurs; activités indifférenciées des ménages en tant que producteurs de biens et services pour usage propre «U» – Activités des organisations et organismes extra-territoriaux
6	Classification sectorielle supplémentaire	«ETFT» – ETF ( <i>exchange-traded fund</i> ), fonds indiciel coté «MMFT» – MMF ( <i>money market fund</i> ), fonds monétaire «REIT» – REIT ( <i>real estate investment trust</i> ) SCPI «OTHR» – Autre
7	Succursale de la contrepartie déclarante	Code pays ISO 3166-1 alpha-2, à 2 caractères alphabétiques
8	Succursale de l'autre contrepartie	Code pays ISO 3166-1 alpha-2, à 2 caractères alphabétiques
9	Côté de la contrepartie	«TAKE» – preneur de sûretés «GIVE» – fournisseur de sûretés
10	Entité chargée de la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
11	Autre contrepartie	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques Code client (jusqu'à 50 caractères alphanumériques)
12	Pays de l'autre contrepartie	Code pays ISO 3166-1 alpha-2, à 2 caractères alphabétiques

N°	Champ	Format
13	Bénéficiaire	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques Code client (jusqu'à 50 caractères alphanumériques)
14	Agent tripartite	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
15	Courtier	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
16	Membre compensateur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
17	Participant ou participant indirect à un dépositaire central de titres (CSD)	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
18	Agent prêteur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques

- (1) Directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 concernant l'accès à l'activité des établissements de crédit et la surveillance prudentielle des établissements de crédit et des entreprises d'investissement (JO L 176 du 27.6.2013, p. 338).
- (2) Règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil du 15 octobre 2013 confiant à la Banque centrale européenne des missions spécifiques ayant trait aux politiques en matière de surveillance prudentielle des établissements de crédit (JO L 287 du 29.10.2013, p. 63).
- (3) Directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers (JO L 173 du 12.6.2014, p. 349).
- (4) Directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2009 sur l'accès aux activités de l'assurance et de la réassurance et leur exercice (solvabilité II) (JO L 335 du 17.12.2009, p. 1).
- (5) Directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2011 sur les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs (JO L 174 du 1.7.2011, p. 1).
- (6) Directive 2003/41/CE du Parlement européen et du Conseil du 3 juin 2003 concernant les activités et la surveillance des institutions de retraite professionnelle (JO L 235 du 23.9.2003, p. 10).
- (7) Règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux (JO L 201 du 27.7.2012, p. 1).
- (8) Règlement (UE) n° 909/2014 du Parlement européen et du Conseil du 23 juillet 2014 concernant l'amélioration du règlement de titres dans l'Union européenne et les dépositaires centraux de titres (JO L 257 du 28.8.2014, p. 1).
- (9) Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) (JO L 302 du 17.11.2009, p. 32).
- (10) 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 (JO L 393 du 30.12.2006, p. 1).

Tableau 2

**Données relatives aux prêts et aux sûretés**

N°	Champ	Format
1	Identifiant de transaction unique (UTI)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z inclus et les chiffres de 0 à 9 inclus sont autorisés.
2	Numéro de suivi de la déclaration	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z inclus et les chiffres de 0 à 9 inclus sont autorisés.
3	Date de l'événement	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
4	Type d'OFT	«SLEB» ( <i>securities or commodities lending or borrowing</i> ) – prêt ou emprunt de titres ou de matières premières «SBSC» ( <i>buy-sell back transaction</i> ou <i>sell-buy back transaction</i> ) – opération d'achat-revente ou de vente-rachat «REPO» ( <i>repurchase transaction</i> ) – opération de pension «MGLD» ( <i>margin lending transaction</i> ) – opération de prêt avec appel de marge



N°	Champ	Format
5	Opération compensée	«true» (vrai) «false» (faux)
6	Horodatage de la compensation	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
7	Contrepartie centrale (CCP)	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
8	Plate-forme de négociation	Code d'identification de marché (MIC) ISO 10383 à 4 caractères alphanumériques. Lorsque des MIC de segments de marché existent pour une plate-forme de négociation, utiliser le MIC de segment de marché.
9	Type d'accord-cadre	<p>«MRAA» – MRA (<i>Master Repurchase Agreement</i>)</p> <p>«GMRA» – GMRA (<i>Global Master Repurchase Agreement</i>)</p> <p>«MSLA» – MSLA (<i>Master Securities Loan Agreement</i>)</p> <p>«GMSL» – GMSLA (<i>Global Master Securities Lending Agreement</i>)</p> <p>«ISDA» – ISDA (<i>International Swaps and Derivatives Association master agreement</i>)</p> <p>«DERP» – <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte</i></p> <p>«CNBR» – <i>China Bond Repurchase Master Agreement</i></p> <p>«KRRR» – <i>Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement</i></p> <p>«CARA» – <i>Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement</i></p> <p>«FRFB» – <i>Convention-Cadre Relative aux Opérations de Pensions Livrées</i></p> <p>«CHRA» – <i>Swiss Master Repurchase Agreement</i></p> <p>«DEMA» – <i>German Master Agreement</i></p> <p>«JPBR» – <i>Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds</i></p> <p>«ESRA» – <i>Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores</i></p> <p>«OSLA» – <i>Overseas Securities Lending Agreement</i></p> <p>«MEFI» – <i>Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA)</i></p> <p>«GESL» – <i>Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA)</i></p> <p>«KRSL» – <i>Korean Securities Lending Agreement (KOSLA)</i></p> <p>«DERD» – <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen</i></p> <p>«AUSL» – <i>Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA)</i></p> <p>«JPBL» – <i>Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds</i></p> <p>«JPSL» – <i>Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates</i></p> <p>«BIAG» – <i>bilateral agreement</i></p> <p>«CSDA» – <i>CSD bilateral agreement</i></p> <p>ou «OTHR» (Autre) si le type d'accord-cadre ne figure pas dans la liste ci-dessus</p>
10	Autre type d'accord-cadre	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques
11	Version de l'accord-cadre	Date au format ISO 8601 (AAAA)
12	Horodatage de l'exécution	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
13	Date de valeur (date de début)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)

N°	Champ	Format
14	Date d'échéance (date de fin)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
15	Date de cessation	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
16	Préavis minimum	Nombre entier de 3 caractères maximum
17	Date la plus proche de remboursement sur demande	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
18	Indicateur vrac ( <i>general collateral</i> )	«SPEC» ( <i>specific collateral</i> ) – sûreté spécifique «GENE» – sûreté générale
19	Indicateur de livraison selon valeur ( <i>delivery by value</i> - «DBV»)	«true» (vrai) «false» (faux)
20	Méthode de fourniture des sûretés	«TTCA» ( <i>title transfer collateral arrangement</i> ) – contrat de garantie avec transfert de propriété «SICA» ( <i>securities financial collateral arrangement</i> ) – contrat de garantie financière avec constitution de sûreté «SIUR» ( <i>securities financial collateral arrangement with the right of use</i> ) – contrat de garantie financière avec constitution de sûreté et droit d'utilisation
21	Échéance ouverte	«true» (vrai) «false» (faux)
22	Option de résiliation	«EGRN» ( <i>evergreen</i> ) – toujours ouverte «ETSB» ( <i>extendable</i> ) – renouvelable «NOAP» – non applicable

Dans le cas d'un prêt avec appel de marge, les champs 23 à 34 sont répétés et complétés pour chaque monnaie utilisée dans le cadre du prêt.

23	Taux fixe	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100». Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
24	Convention de calcul des jours	Code représentant la convention de calcul des jours: «A001» – IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule «A002» – IC30365 «A003» – IC30Actual «A004» – Actual360 «A005» – Actual365Fixed «A006» – ActualActualICMA «A007» – IC30E360orEuroBondBasismodel1 «A008» – ActualActualISDA «A009» – Actual365LorActuActubasisRule «A010» – ActualActualAFB «A011» – IC30360ICMAor30360basicrule «A012» – IC30E2360orEurobondbasismodel2 «A013» – IC30E3360orEurobondbasismodel3 «A014» – Actual365NL ou jusqu'à 35 caractères alphanumériques si la convention de calcul des jours ne figure pas dans la liste ci-dessus

N°	Champ	Format
25	Taux variable	Code de l'indice du taux variable «EONA» – EONIA «EONS» – EONIA SWAP «EURI» – EURIBOR «EUUS» – EURODOLLAR «EUCH» – EuroSwiss «GCFR» – GCF REPO «ISDA» – ISDAFIX «LIBI» – LIBID «LIBO» – LIBOR «MAAA» – Muni AAA «PFAN» – Pfandbriefe «TIBO» – TIBOR «STBO» – STIBOR «BBSW» – BBSW «JIBA» – JIBAR «BUBO» – BUBOR «CDOR» – CDOR «CIBO» – CIBOR «MOSP» – MOSPRIM «NIBO» – NIBOR «PRBO» – PRIBOR «TLBO» – TELBOR «WIBO» – WIBOR «TREA» – Trésor «SWAP» – Contrats d'échange «FUSW» – Contrats d'échange à terme (future SWAP) ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas dans la liste ci-dessus
26	Période de référence du taux variable – unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» – Année «MNTH» – Mois «WEEK» – Semaine «DAYS» – Jour
27	Période de référence du taux variable – multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Jusqu'à 3 caractères numériques.
28	Fréquence de paiement du taux variable – unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» – Année «MNTH» – Mois «WEEK» – Semaine «DAYS» – Jour
29	Fréquence de paiement du taux variable – multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.

N°	Champ	Format
30	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable de l'opération de pension. Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» – Année «MNTH» – Mois «WEEK» – Semaine «DAYS» – Jour
31	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable de l'opération de pension. Jusqu'à 3 caractères numériques.
32	Écart ( <i>spread</i> )	Jusqu'à 5 caractères numériques.
33	Montant monétaire du prêt avec appel de marge	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
34	Monnaie du prêt avec appel de marge	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.

Les champs 35 et 36 sont répétés et complétés pour chaque ajustement du taux variable.

35	Taux ajusté	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100». Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
36	Date d'application du taux	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
37	Montant en principal à la date de valeur	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
38	Montant en principal à la date d'échéance	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
39	Monnaie du montant en principal	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
40	Type d'actif	«SECU» ( <i>securities</i> ) – Titres «COMM» ( <i>commodities</i> ) – Matières premières
41	Identifiant du titre	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques.
42	Classification du titre	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques.

Lorsqu'une matière première a été prêtée ou empruntée, il convient de préciser la classification de cette matière première dans les champs 43, 44 et 45.

43	Catégorie de produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
----	----------------------	--

N°	Champ	Format
44	Sous-catégorie de produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Sous-catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
45	Produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
46	Quantité ou montant nominal	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
47	Unité de mesure	«KILO» - Kilogram (Kilogramme), «PIEC» - Piece (Pièce), «TONS» - Ton (Tonne), «METR» - Metre (Mètre), «INCH» - Inch (Pouce), «YARD» - Yard (Yard), «GBGA» - GBGallon (Gallon britannique), «GRAM» - Gram (Gramme), «CMET» - Centimetre (Centimètre), «SMET» - SquareMetre (Mètre carré), «FOOT» - Foot (Pied), «MILE» - Mile (Mille), «SQIN» - SquareInch (Pouce carré), «SQFO» - SquareFoot (Pied carré), «SQMI» - SquareMile (Mille carré), «GBOU» - GBOunce (Once britannique), «USOU» - USOunce (Once US), «GBPI» - GBPint (Pinte britannique), «USPI» - USPint (Pinte US), «GBQA» - GBQuart (Quart britannique), «USQA» - USQuart (Quart US), «USGA» - USGallon (Gallon US), «MMET» - Millimetre (Millimètre), «KMET» - Kilometre (Kilomètre), «SQYA» - SquareYard (Yard carré), «ACRE» - Acre (Acre), «ARES» - Are (Are), «SMIL» - SquareMillimetre (Millimètre carré), «SCMT» - SquareCentimetre (Centimètre carré), «HECT» - Hectare (Hectare), «SQKI» - SquareKilometre (Kilomètre carré), «MILI» - MilliLitre (Millilitre), «CELL» - Centilitre (Centilitre), «LITR» - Litre (Litre), «PUND» - Pound (Livre), «ALOW» - Allowances (Quotas), «ACCY» - AmountOfCurrency (Montant de monnaie), «BARL» - Barrels (Barils), «BCUF» - BillionCubicFeet (Milliards de pieds cubes), «BDFT» - BoardFeet (Pieds-planches), «BUSL» - Bushels (Boisseaux), «CEER» - CertifiedEmissionsReduction (Unité de réduction certifiée des émissions), «CLRT» - ClimateReserveTonnes (Réserve d'Action du Climat), «CBME» - CubicMeters (Mètres cubes), «DAYS» - Days (Jours), «DMET» - DryMetricTons (Tonne métrique sèche), «ENVC» - EnvironmentalCredit (Crédit environnemental), «ENVO» - EnvironmentalOffset (Compensation environnementale), «HUWG» - Hundredweight, «KWDC» - KilowattDayCapacity (Capacité en kilowatt-jour), «KWHO» - KilowattHours (Kilowatt-heures), «KWHC» - KilowattHoursCapacity (Capacité en kilowatt-heures), «KMOC» - KilowattMinuteCapacity (Capacité en kilowatt-minute), «KWMC» - KilowattMonthCapacity (Capacité en kilowatt-mois), «KWYC» - KilowattYearCapacity (Capacité en kilowatt-an), «MWDC» - MegawattDayCapacity (Capacité en mégawatt-jour), «MWHO» - MegawattHours (Mégawatt-heure), «MWHC» - MegawattHoursCapacity (Capacité en mégawatt-heure), «MWMC» - MegawattMinuteCapacity (Capacité en mégawatt-minute), «MMOC» - MegawattMonthCapacity (Capacité en mégawatt-mois), «MWYC» - MegawattYearCapacity (Capacité en mégawatt-an), «TONE» - MetricTons (Tonnes métriques), «MIBA» - MillionBarrels (Million de barils), «MBTU» - OneMillionBTU (Un million de BTU), «OZTR» - TroyOunces (Onces Troy), «UCWT» - USHundredweight (Hundredweight US), «IPNT» - IndexPoint (Point d'indice), «PWRD» - PrincipalWithRelationToDebtInstrument (Principal relativement à un instrument de dette), «DGEU» - DieselGallonEquivalent (Équivalent gallon diesel), «GGEU» - GasolineGallonEquivalent (Équivalent gallon essence), «TOCD» - TonsOfCarbonDioxide (Tonnes de dioxyde de carbone).
48	Monnaie du montant nominal	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
49	Prix des titres ou matières premières	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales, si le prix est exprimé en unités. Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, si le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou en taux de rendement. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
50	Monnaie du prix	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.

N°	Champ	Format
51	Qualité du titre	«INVG» ( <i>investment grade</i> ) – Catégorie investissement «NIVG» ( <i>non-investment grade</i> ) – Catégorie spéculative «NOTR» ( <i>non-rated</i> ) – Non notée «NOAP» – Non applicable
52	Échéance du titre	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
53	Juridiction dont dépend l'émetteur	Code pays ISO 3166-1 alpha-2, à 2 caractères alphabétiques
54	LEI de l'émetteur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
55	Type de titre	«GOVS» ( <i>government securities</i> ) – Titres d'État «SUNS» ( <i>Supra-nationals and agencies securities</i> ) – Titres émis par des émetteurs supranationaux ou des agences «FIDE» – Titres de créance (y compris obligations garanties) émis par des banques et autres établissements financiers «NFID» – Titres de créance d'entreprises (y compris obligations garanties) émis par des établissements non financiers «SEPR» ( <i>securitized products</i> ) – Produits titrisés (y compris CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» ( <i>main index equities</i> ) – Actions faisant partie d'un indice important (y compris obligations convertibles) «OEU» ( <i>other equities</i> ) – Autres actions (y compris obligations convertibles) «OTHR» ( <i>other assets</i> ) – Autres actifs (y compris parts d'organismes de placement collectif)
56	Valeur du prêt	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
57	Valeur de marché	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
58	Taux de rémunération fixe ( <i>fixed rebate rate</i> )	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100». Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.
59	Taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> )	Code de l'indice du taux variable «EONA» – EONIA «EONS» – EONIA SWAP «EURI» – EURIBOR «EUUS» – EURODOLLAR «EUCH» – EuroSwiss «GCFR» – GCF REPO «ISDA» – ISDAFIX «LIBI» – LIBID «LIBO» – LIBOR «MAAA» – Muni AAA «PFAN» – Pfandbriefe «TIBO» – TIBOR «STBO» – STIBOR «BBSW» – BBSW

N°	Champ	Format
		«JIBA» – JIBAR «BUBO» – BUBOR «CDOR» – CDOR «CIBO» – CIBOR «MOSP» – MOSPRIM «NIBO» – NIBOR «PRBO» – PRIBOR «TLBO» – TELBOR «WIBO» – WIBOR «TREA» – Trésor «SWAP» – Contrats d'échange «FUSW» – Contrats d'échange à terme (future SWAP) ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas dans la liste ci-dessus.
60	Période de référence du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» - Année «MNTH» - Mois «WEEK» - Semaine «DAYS» - Jour
61	Période de référence du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la période de référence du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ). Jusqu'à 3 caractères numériques.
62	Fréquence de paiement du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» - Année «MNTH» - Mois «WEEK» - Semaine «DAYS» - Jour
63	Fréquence de paiement du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.
64	Fréquence de révision du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ). Les abréviations suivantes sont utilisées: «YEAR» - Année «MNTH» - Mois «WEEK» - Semaine «DAYS» - Jour
65	Fréquence de révision du taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ) - multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux de rémunération variable ( <i>floating rebate rate</i> ). Jusqu'à 3 caractères numériques.
66	Écart ( <i>spread</i> ) du taux de rémunération ( <i>rebate rate</i> )	Jusqu'à 5 caractères numériques.
67	Commission de prêt ( <i>lending fee</i> )	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimée sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100».

N°	Champ	Format
68	Accords d'exclusivité	«true» (vrai) «false» (faux)
69	Encours des prêts avec appel de marge	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
70	Monnaie principale de l'encours des prêts avec appel de marge	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
71	Valeur de marché des positions courtes	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

## Données sur les sûretés

72	Code signalétique «SL» pour prêt de titres ( <i>securities lending</i> ) non garanti par des sûretés	«true» (vrai) «false» (faux)
73	Couverture par des sûretés de l'exposition nette	«true» (vrai) «false» (faux)
74	Date de valeur de la sûreté	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)

Lorsque des sûretés spécifiques ont été utilisées, les champs 75 à 94 sont répétés et complétés pour chaque composante des sûretés, le cas échéant.

75	Type de composante des sûretés	«SECU» - Titres «COMM» - Matières premières (uniquement pour les opérations de pension, les prêts et emprunts de titres et de matières premières et les opérations d'achat-revente) «CASH» - Espèces
----	--------------------------------	--

Lorsque des espèces ont été utilisées comme sûretés, il convient de le préciser dans les champs 76 et 77.

76	Montant des sûretés en espèces	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
77	Monnaie des sûretés en espèces	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
78	Identifiant du titre utilisé en tant que sûreté	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques.
79	Classification du titre utilisé en tant que sûreté	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques.



N°	Champ	Format
Lorsqu'une matière première a été utilisée en tant que sûreté, il convient de préciser la classification de cette matière première dans les champs 80, 81 et 82.		
80	Catégorie de produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
81	Sous-catégorie de produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Sous-catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
82	Produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
83	Quantité ou montant nominal de la sûreté	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
84	Unité de mesure de la sûreté	«KILO» - Kilogram (Kilogramme), «PIEC» - Piece (Pièce), «TONS» - Ton (Tonne), «METR» - Metre (Mètre), «INCH» - Inch (Pouce), «YARD» - Yard (Yard), «GBGA» - GBGallon (Gallon britannique), «GRAM» - Gram (Gramme), «CMET» - Centimetre (Centimètre), «SMET» - SquareMetre (Mètre carré), «FOOT» - Foot (Pied), «MILE» - Mile (Mille), «SQIN» - SquareInch (Pouce carré), «SQFO» - SquareFoot (Pied carré), «SQMI» - SquareMile (Mille carré), «GBOU» - GBOunce (Once britannique), «USOU» - USOunce (Once US), «GBPI» - GBPint (Pinte britannique), «USPI» - USPint (Pinte US), «GBQA» - GBQuart (Quart britannique), «USQA» - USQuart (Quart US), «USGA» - USGallon (Gallon US), «MMET» - Millimetre (Millimètre), «KMET» - Kilometre (Kilomètre), «SQYA» - SquareYard (Yard carré), «ACRE» - Acre (Acre), «ARES» - Are (Are), «SMIL» - SquareMillimetre (Millimètre carré), «SCMT» - SquareCentimetre (Centimètre carré), «HECT» - Hectare (Hectare), «SQKI» - SquareKilometre (Kilomètre carré), «MILI» - MilliLitre (Millilitre), «CELL» - Centilitre (Centilitre), «LITR» - Litre (Litre), «PUND» - Pound (Livre), «ALOW» - Allowances (Quotas), «ACCY» - AmountOfCurrency (Montant de monnaie), «BARL» - Barrels (Barils), «BCUF» - BillionCubicFeet (Milliards de pieds cubes), «BDFT» - BoardFeet (Pieds-planches), «BUSL» - Bushels (Boisseaux), «CEER» - CertifiedEmissionsReduction (Unité de réduction certifiée des émissions), «CLRT» - ClimateReserveTonnes (Réserve d'Action du Climat), «CBME» - CubicMeters (Mètres cubes), «DAYS» - Days (Jours), «DMET» - DryMetricTons (Tonne métrique sèche), «ENVC» - EnvironmentalCredit (Crédit environnemental), «ENVO» - EnvironmentalOffset (Compensation environnementale), «HUWG» - Hundredweight, «KWDC» - KilowattDayCapacity (Capacité en kilowatt-jour), «KWHO» - KilowattHours (Kilowatt-heures), «KWHC» - KilowattHoursCapacity (Capacité en kilowatt-heures), «KMOC» - KilowattMinuteCapacity (Capacité en kilowatt-minute), «KWMC» - KilowattMonthCapacity (Capacité en kilowatt-mois), «KWYC» - KilowattYearCapacity (Capacité en kilowatt-an), «MWDC» - MegawattDayCapacity (Capacité en mégawatt-jour), «MWHO» - MegawattHours (Mégawatt-heure), «MWHC» - MegawattHoursCapacity (Capacité en mégawatt-heure), «MWMC» - MegawattMinuteCapacity (Capacité en mégawatt-minute), «MMOC» - MegawattMonthCapacity (Capacité en mégawatt-mois), «MWYC» - MegawattYearCapacity (Capacité en mégawatt-an), «TONE» - MetricTons (Tonnes métriques), «MIBA» - MillionBarrels (Million de barils), «MBTU» - OneMillionBTU (Un million de BTU), «OZTR» - TroyOunces (Onces Troy), «UCWT» - USHundredweight (Hundredweight US), «IPNT» - IndexPoint (Point d'indice), «PWRD» - PrincipalWithRelationToDebtInstrument (Principal relativement à un instrument de dette), «DGEU» - DieselGallonEquivalent (Équivalent gallon diesel), «GGEU» - GasolineGallonEquivalent (Équivalent gallon essence), «TOCD» - TonsOfCarbonDioxide (Tonnes de dioxyde de carbone).
85	Monnaie du montant nominal de la sûreté	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
86	Monnaie du prix	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
87	Prix unitaire	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales, si le prix est exprimé en unités. Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, si le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou en taux de rendement. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

N°	Champ	Format
88	Valeur de marché de la sûreté	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
89	Décote ou marge	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimée sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100». Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
90	Qualité de la sûreté	«INVG» - Catégorie investissement (investment grade) «NIVG» - Catégorie spéculative (non-investment grade) «NOTR» - Non notée «NOAP» - Non applicable
91	Date d'échéance de la sûreté	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
92	Juridiction dont dépend l'émetteur	Code pays ISO 3166-1 alpha-2, à 2 caractères alphabétiques.
93	LEI de l'émetteur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
94	Type de sûreté	«GOVS» - Titres d'État «SUNS» - Titres émis par des émetteurs supranationaux ou des agences «FIDE» - Titres de créance (y compris obligations garanties) émis par des banques et autres établissements financiers «NFID» - Titres de créance d'entreprises (y compris obligations garanties) émis par des établissements non financiers «SEPR» - Produits titrisés (y compris CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» - Actions faisant partie d'un indice important (y compris obligations convertibles) «OEQU» - Autres actions (y compris obligations convertibles) «OTHR» - Autres actifs (y compris parts d'organismes de placement collectif)
95	Possibilité de réutiliser la sûreté	«true» (vrai) «false» (faux)

Le champ 96 doit être complété lorsqu'un panier de sûretés a été utilisé. La répartition détaillée des sûretés pour les OFT conclues en échange d'un panier de sûretés doit être précisée dans les champs 75 à 94 si disponible.

96	Identifiant du panier de sûretés	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques, ou «NTAV»
97	Code du portefeuille	Code à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: · - _ Le code ne peut ni commencer ni finir par un caractère spécial. Il ne peut comporter aucun espace.
98	Type d'action	«NEWT» - Nouveau «MODI» - Modification «VALU» - Valorisation «COLU» - Actualisation des sûretés «EROR» - Erreur «CORR» - Correction

N°	Champ	Format
		«ETRM» - Résiliation/Résiliation anticipée «POSC» - Composante de la position
99	Niveau	«TCTN» - Transaction «PSTN» - Position

Tableau 3

**Données sur les marges**

N°	Champ	Format
1	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
2	Date de l'événement	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
3	Entité qui soumet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
4	Contrepartie déclarante	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
5	Entité chargée de la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
6	Autre contrepartie	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
7	Code du portefeuille	Code à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: · - _ Le code ne peut ni commencer ni finir par un caractère spécial. Il ne peut comporter aucun espace.
8	Marge initiale fournie	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
9	Monnaie de la marge initiale fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
10	Marge de variation fournie	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
11	Monnaie de la marge de variation fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
12	Marge initiale reçue	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
13	Monnaie de la marge initiale reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
14	Marge de variation reçue	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

N°	Champ	Format
15	Monnaie de la marge de variation reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
16	Sûretés excédentaires fournies	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
17	Monnaie des sûretés excédentaires fournies	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
18	Sûretés excédentaires reçues	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
19	Monnaie des sûretés excédentaires reçues	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
20	Type d'action	«NEWT» - Nouveau «MARU» - Actualisation des marges «EROR» - Erreur «CORR» - Correction

Tableau 4

**Données relatives à la réutilisation, au réinvestissement d'espèces et aux sources de financement**

N°	Champ	Format
1	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
2	Date de l'événement	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
3	Entité qui soumet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
4	Contrepartie déclarante	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
5	Entité chargée de la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques

Le champ 6 doit être répété et complété pour chaque composante des sûretés.

6	Type de composante des sûretés	«SECU» - Titres «CASH» - Espèces
---	--------------------------------	-------------------------------------

Les champs 7, 8, 9 et 10 doivent être répétés et complétés pour chaque titre.

7	Composante des sûretés	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques.
8	Valeur des sûretés réutilisées	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
9	Réutilisation estimée des sûretés	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

N°	Champ	Format
10	Monnaie des sûretés réutilisées	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
11	Taux de réinvestissement	Jusqu'à 11 caractères numériques, dont jusqu'à 10 décimales, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100».

Les champs 12, 13 et 14 doivent être répétés et complétés pour chaque investissement dans lequel des sûretés en espèces ont été réinvesties et pour chaque monnaie.

12	Type d'investissement avec des espèces réinvesties	«MMFT» - fonds monétaire enregistré «OCMP» - tout autre fonds commun ( <i>commingled pool</i> ) «REPM» - le marché des pensions livrées «SDPU» - achat direct de titres «OTHR» - autre
13	Montant des espèces réinvesties	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
14	Monnaie des espèces réinvesties	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.

Dans le cas d'opérations de prêt avec appel de marge, la contrepartie doit répéter et compléter les champs 15, 16 et 17 pour chaque source de financement et fournir les informations dans ces champs au niveau de l'entité.

15	Sources de financement:	«REPO» - opérations de pension ou d'achat-revente «SECL» - sûretés en espèces provenant du prêt de titres «FREE» - crédits gratuits «CSHS» - produits de ventes à découvert du client «BSHS» - produits de ventes à découvert du courtier «UBOR» - emprunt non garanti «OTHR» - autre
16	Valeur de marché des sources de financement	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont jusqu'à 5 décimales Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si cela n'est pas possible, montant au pro rata.
17	Monnaie des sources de financement	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques.
18	Type d'action	«NEWT» - Nouveau «REUU» - Actualisation de la réutilisation «EROR» - Erreur «CORR» - Correction

Tableau 5

### Classification des matières premières

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
«AGRI» – Produits agricoles	«GROS» – Grains et oléagineux	«FWHT» – Blé fourrager «SOYB» – Graines de soja «CORN» – Maïs «RPSD» – Colza «RICE» – Riz «OTHR» – Autres

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
	«SOFT» – Produits non durables	«CCOA» – Cacao «ROBU» – Café robusta «WHSG» – Sucre blanc «BRWN» – Sucre brut «OTHR» – Autres
	«POTA» – Pomme de terre	
	«OOLI» – Huile d'olive	«LAMP» – Huile d'olive lampante «OTHR» – Autres
	«DIRY» – Produits laitiers	
	«FRST» – Produits sylvicoles	
	«SEAF» – Produits de la mer	
	«LSTK» – Bétail	
	«GRIN» – Céréales	«MWHT» – Blé meunier «OTHR» – Autres
	«OTHR» – Autres	
«NRGY» – Énergie	«ELEC» – Électricité	«BSLD» – Charge de base «FITR» – Droits financiers de transport «PKLD» – Charge de pointe «OFFP» – Hors période de pointe «OTHR» – Autres
	«NGAS» – Gaz naturel	«GASP» – GASPOOL «LNGG» – Gaz naturel liquéfié (GNL) «NBPG» – National Balancing Point (NBP) «NCGG» – NetConnect Germany (NCG) «TTFG» – Title Transfer Facility (TTF) «OTHR» – Autres
	«OILP» – Pétrole	«BAKK» – Bakken «BDSL» – Biodiesel «BRNT» – Brent «BRNX» – Brent NX «CNDA» – Canadian «COND» – Condensats «DSEL» – Diesel «DUBA» – Dubaï «ESPO» – ESPO «ETHA» – Éthanol «FUEL» – Fioul «FOIL» – Mazout «GOIL» – Gasoil

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
		«GSLN» – Essence «HEAT» – Mazout de chauffage «JTFL» – Carburéacteurs «KERO» – Kérosène «LLSO» – Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» – Mars «NAPH» – Naphtha «NGLO» – Liquides de gaz naturel (LGN) «TAPI» – Tapis «URAL» – Urals «WTIO» – West Texas Intermediate (WTI) «OTHR» – Autres
	«COAL» – Charbon «INRG» – Interénergies «RNGG» – Énergies renouvelables «LGHT» – Fractions légères «DIST» – Distillats «OTHR» – Autres	
«ENVR» – Environnement	«EMIS» – Émissions	«CERE» – Unités de réduction certifiée des émissions (URCE) «ERUE» – Unités de réduction des émissions (URE) «EUA» – Quotas d'émission de l'Union européenne (EUA) «EUAA» – Quotas du secteur de l'aviation de l'Union européenne «OTHR» – Autres
	«WTHR» – Climatique «CRBR» – Carbone «OTHR» – Autres	
«FRGT» – Fret	«WETF» – Vrac liquide	«TNKR» – Navires citernes «OTHR» – Autres
	«DRYF» – Vrac solide	«DBCR» – Vraquiers «OTHR» – Autres
	«CSHP» – Navires porte-conteneurs	
	«OTHR» – Autres	
«FRTL» – Engrais	«AMMO» – Ammoniac «DAPH» – Phosphate diammonique «PTSH» – Potasse «SLPH» – Soufre «UREA» – Urée «UAAN» – Urée et nitrate d'ammonium «OTHR» – Autres	

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
«INDP» – Produits industriels	«CSTR» – Construction «MFTG» – Fabrication	
«METL» – Métaux	«NPRM» – Non précieux	«ALUM» – Aluminium «ALUA» – Alliage d'aluminium «CBLT» – Cobalt «COPR» – Cuivre «IRON» – Minerai de fer «LEAD» – Plomb «MOLY» – Molybdène «NASC» – North American Special Aluminium Alloy Contract (NASAAC) «NICK» – Nickel «STEL» – Acier «TINN» – Étain «ZINC» – Zinc «OTHR» – Autres
	«PRME» – Précieux	«GOLD» – Or «SLVR» – Argent «PTNM» – Platine «PLDM» – Palladium «OTHR» – Autres
«MCEX» – Exotiques multi-produits		
«PAPR» – Papier	«CBRD» – Papier pour carton ondulé «NSPT» – Papier journal «PULP» – Pâte à papier «RCVP» – Papier recyclé «OTHR» – Autres	
«POLY» – Polypropylène	«PLST» – Plastiques «OTHR» – Autres	
«INFL» – Inflation		
«OEST» – Statistiques économiques officielles		
«OTHC» – Autres C10 au sens du tableau 10.1 de la section 10 de l'annexe III du règlement délégué (UE) 2017/583 de la Commission <sup>(1)</sup>		
«OTHR» – Autres		

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



## ANNEXE II

L'annexe du règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 est remplacée par le texte suivant:

«ANNEXE

Tableau 1

**Données sur les contreparties**

	Champ	Format
	Parties au contrat	
1	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Identifiant de la contrepartie déclarante	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
3	Type d'identifiant de l'autre contrepartie	«LEI», pour l'identifiant d'entité juridique de la norme ISO 17442. «CLC», pour un code client.
4	Identifiant de l'autre contrepartie	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques Code client (jusqu'à 50 caractères alphanumériques).
5	Pays de l'autre contrepartie	Code pays ISO 3166 à 2 caractères
6	Secteur de la contrepartie déclarante	<p>Taxinomie des contreparties financières:</p> <p>A = une entreprise d'assurance vie agréée conformément à la directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(1)</sup></p> <p>C = un établissement de crédit agréé conformément à la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil <sup>(2)</sup></p> <p>F = une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive 2004/39/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(3)</sup></p> <p>I = une entreprise d'assurance agréée conformément à la directive 2009/138/CE</p> <p>L = un fonds d'investissement alternatif géré par un gestionnaire de fonds d'investissement alternatif agréé ou enregistré conformément à la directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil <sup>(4)</sup></p> <p>O = une institution de retraite professionnelle au sens de l'article 6, point a), de la directive 2003/41/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(5)</sup></p> <p>R = une entreprise de réassurance agréée conformément à la directive 2009/138/CE</p> <p>U = un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) et sa société de gestion, agréés conformément à la directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil <sup>(6)</sup></p> <p>Taxinomie des contreparties non financières. Les catégories suivantes correspondent aux principales sections de la nomenclature statistique des activités économiques dans la Communauté européenne (NACE) telle que définie dans le règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil <sup>(7)</sup></p> <p>1 = Agriculture, sylviculture et pêche</p> <p>2 = Industries extractives</p> <p>3 = Industrie manufacturière</p> <p>4 = Production et distribution d'électricité, de gaz, de vapeur et d'air conditionné</p>

	Champ	Format
		5 = Production et distribution d'eau, assainissement, gestion des déchets et dépollution 6 = Construction 7 = Commerce; réparation d'automobiles et de motocycles 8 = Transports et entreposage 9 = Hébergement et restauration 10 = Information et communication 11 = Activités financières et d'assurance 12 = Activités immobilières 13 = Activités spécialisées, scientifiques et techniques 14 = Activités de services administratifs et de soutien 15 = Administration publique et défense; sécurité sociale obligatoire 16 = Enseignement 17 = Santé humaine et action sociale 18 = Arts, spectacles et activités récréatives 19 = Autres activités de services 20 = Activités des ménages en tant qu'employeurs; activités indifférenciées des ménages en tant que producteurs de biens et services pour usage propre 21 = Activités des organisations et organismes extraterritoriaux Lorsque plusieurs activités sont déclarées, lister les codes par ordre d'importance relative des activités correspondantes, en les séparant par un tiret «-». Laisser la case vierge pour les contreparties centrales et les autres types de contreparties visés à l'article 1 <sup>er</sup> , paragraphe 5, du règlement (UE) n° 648/2012.
7	Nature de la contrepartie déclarante	F = contrepartie financière N = contrepartie non financière C = contrepartie centrale O = autre
8	Identifiant du courtier	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
9	Identifiant de l'entité qui soumet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
10	Identifiant du membre compensateur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
11	Type d'identifiant du bénéficiaire	«LEI», pour l'identifiant d'entité juridique de la norme ISO 17442 «CLC», pour un code client
12	Identifiant du bénéficiaire	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques ou code client comprenant jusqu'à 50 caractères alphanumériques si le client n'a pas droit à un identifiant d'entité juridique
13	Capacité de négociation	P = pour compte propre A = en tant qu'agent
14	Côté de la contrepartie	B = acheteur ( <i>buyer</i> ) S = vendeur ( <i>seller</i> ) À compléter conformément à l'article 3 bis.

	Champ	Format
15	Lien direct avec l'activité commerciale ou le financement de trésorerie	Y = Oui N = Non
16	Seuil de compensation	Y = au-dessus du seuil N = en dessous du seuil
17	Valeur du contrat	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.
18	Monnaie de la valeur	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
19	Horodatage de la valorisation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ
20	Type de valorisation	M = valorisation au prix du marché O = valorisation par référence à un modèle C = valorisation par la contrepartie centrale
21	Collatéralisation (constitution de sûretés)	U = non collatéralisé ( <i>uncollateralised</i> ) PC = partiellement collatéralisé OC = collatéralisé à sens unique ( <i>one-way collateralised</i> ) FC = pleinement collatéralisé ( <i>fully collateralised</i> ) À compléter conformément à l'article 3 <i>ter</i> .
22	Portefeuille de sûretés (collatéral)	Y = Oui N = Non
23	Code du portefeuille de sûretés	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: «. - _» Le code ne peut ni commencer ni finir par un caractère spécial. Il ne peut comporter aucun espace.
24	Marge initiale fournie	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
25	Monnaie de la marge initiale fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
26	Marge de variation fournie	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
27	Monnaie de la marge de variation fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
28	Marge initiale reçue	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
29	Monnaie de la marge initiale reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques

	Champ	Format
30	Marge de variation reçue	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
31	Monnaie de la marge de variation reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
32	Sûretés excédentaires fournies	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
33	Monnaie des sûretés excédentaires fournies	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
34	Sûretés excédentaires reçues	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
35	Monnaie des sûretés excédentaires reçues	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques

- (1) Directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2009 sur l'accès aux activités de l'assurance et de la réassurance et leur exercice (solvabilité II) (JO L 335 du 17.12.2009, p. 1).
- (2) Directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 concernant l'accès à l'activité des établissements de crédit et la surveillance prudentielle des établissements de crédit et des entreprises d'investissement, modifiant la directive 2002/87/CE et abrogeant les directives 2006/48/CE et 2006/49/CE (JO L 176 du 27.6.2013, p. 338).
- (3) Directive 2004/39/CE du Parlement européen et du Conseil du 21 avril 2004 concernant les marchés d'instruments financiers, modifiant les directives 85/611/CEE et 93/6/CEE du Conseil et la directive 2000/12/CE du Parlement européen et du Conseil et abrogeant la directive 93/22/CEE du Conseil (JO L 145 du 30.4.2004, p. 1).
- (4) Directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2011 sur les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs et modifiant les directives 2003/41/CE et 2009/65/CE ainsi que les règlements (CE) n° 1060/2009 et (UE) n° 1095/2010 (JO L 174 du 1.7.2011, p. 1).
- (5) Directive 2003/41/CE du Parlement européen et du Conseil du 3 juin 2003 concernant les activités et la surveillance des institutions de retraite professionnelle (JO L 235 du 23.9.2003, p. 10).
- (6) Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) (JO L 302 du 17.11.2009, p. 32).
- (7) 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).

Tableau 2

## Données communes

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
	Section 2 a – Type de contrat		Tous les contrats
1	Type de contrat	CD = contrat financier avec paiement d'un différentiel ( <i>financial contract for difference</i> ) FR = accord de taux futur FU = contrat à terme standardisé ( <i>future</i> ) FW = contrat à terme négocié de gré à gré ( <i>forward</i> ) OP = option SB = spéculation sur écart ( <i>spreadbet</i> ) SW = contrat d'échange ( <i>swap</i> ) ST = option d'échange ( <i>swaption</i> ) OT = autre ( <i>other</i> )	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
2	Catégorie d'actif	CO = matières premières et quotas d'émission ( <i>commodity and emission allowances</i> ) CR = crédit CU = monnaie ( <i>currency</i> ) EQ = actions ( <i>equity</i> ) IR = taux d'intérêt ( <i>interest rate</i> )	
	Section 2 b – Informations contractuelles		Tous les contrats
3	Type de classification du produit	C = code CFI ( <i>classification of financial instruments</i> )	
4	Classification du produit	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques	
5	Type d'identification du produit	Préciser l'identifiant applicable: I = code ISIN A = code AII ( <i>alternative instrument identifier</i> )	
6	Identification du produit	Pour un identifiant de produit de type I: Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques Pour un identifiant de produit de type A: Code AII complet	
7	Type d'identification du sous-jacent	I = code ISIN A = code AII ( <i>alternative instrument identifier</i> ) B = panier ( <i>basket</i> ) X = indice	
8	Identification du sous-jacent	Pour un identifiant du sous-jacent de type I: code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques Pour un identifiant du sous-jacent de type A: code AII complet Pour un identifiant du sous-jacent de type B: code ISIN ISO 6166 ou code AII complet de toutes les composantes. Les identifiants des différentes composantes sont séparés par un tiret «-». Pour un identifiant du sous-jacent de type X: code ISIN ISO 6166 si disponible, sinon nom complet de l'indice tel qu'attribué par le fournisseur de l'indice	
9	Monnaie du notionnel 1	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques	
10	Monnaie du notionnel 2	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques	
11	Monnaie de règlement	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques	
	Section 2 c – Détails de la transaction		Tous les contrats
12	Identifiant de la transaction	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques dont quatre caractères spéciaux: «. - _» Le code ne peut ni commencer ni finir par un caractère spécial. Il ne peut comporter aucun espace.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
13	Numéro de suivi de la déclaration	Champ alphanumérique de 52 caractères maximum	
14	Identifiant des composantes de transactions complexes	Champ alphanumérique de 35 caractères maximum	
15	Lieu d'exécution	Code d'identification de marché (MIC) ISO 10383 à 4 caractères alphanumériques, conformément à l'article 4 <i>ter</i>	
16	Compression	Y = si le contrat résulte d'une compression N = si le contrat ne résulte pas d'une compression	
17	Prix/taux	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique. Lorsque le prix est indiqué en pourcentage, le pourcentage est exprimé de telle sorte que 100 % est représenté par «100».	
18	Notation du prix	U = unités P = pourcentage Y = rendement ( <i>yield</i> )	
19	Monnaie du prix	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques	
20	Montant notionnel	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
21	Multiplicateur du prix	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.	
22	Quantité	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.	
23	Paiement initial	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Utiliser le symbole négatif pour indiquer que le paiement a été effectué, mais non reçu. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
24	Modalités de livraison	C = espèces ( <i>cash</i> ) P = physique O = optionnel pour la contrepartie ou décidé par un tiers	
25	Horodatage de l'exécution	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	
26	Date d'entrée en vigueur	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)	
27	Date d'échéance	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)	
28	Date de cessation	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)	
29	Date de règlement	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)	
30	Type d'accord-cadre	Texte libre, champ de 50 caractères maximum, précisant s'il y a lieu le nom de l'accord-cadre utilisé	
31	Version de l'accord-cadre	Date au format ISO 8601 (AAAA)	
	Section 2 d – Atténuation des risques, déclaration		Tous les contrats
32	Horodatage de la confirmation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	
33	Mode de confirmation	Y = confirmation non électronique N = non confirmé E = confirmation électronique	
	Section 2 e – Compensation ( <i>clearing</i> )		Tous les contrats
34	Obligation de compensation	Y = Oui N = Non	
35	Opération compensée	Y = Oui N = Non	
36	Horodatage de la compensation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	
37	Contrepartie centrale (CCP)	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques	
38	Intragroupe	Y = Oui N = Non	
	Section 2 f – Taux d'intérêt		Dérivés de taux d'intérêt
39	Taux fixe de la jambe 1	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100».	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
40	Taux fixe de la jambe 2	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises, exprimé sous la forme d'un pourcentage où 100 % est représenté par «100». Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
41	Décompte des jours du taux fixe, jambe 1	Numérateur/dénominateur où tant le numérateur que le dénominateur sont exprimés en caractères numériques ou par l'expression alphabétique «Actual», par exemple 30/360 ou Actual/365.	
42	Décompte des jours du taux fixe, jambe 2	Numérateur/dénominateur où tant le numérateur que le dénominateur sont exprimés en caractères numériques ou par l'expression alphabétique «Actual», par exemple 30/360 ou Actual/365.	
43	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
44	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
45	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 2 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
46	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 2 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
47	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 1 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
48	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 1 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	



	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
49	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 2 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
50	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 2 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
51	Fréquence de révision du taux variable de la jambe 1 – Unité de temps	Unité de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
52	Fréquence de révision du taux variable de la jambe 1 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
53	Fréquence de révision du taux variable de la jambe 2 – Unité de temps	Unité de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
54	Fréquence de révision du taux variable de la jambe 2 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties révisent le taux variable. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
55	Taux variable de la jambe 1	Nom de l'indice du taux variable: «EONA» – EONIA «EONS» – EONIA SWAP «EURI» – EURIBOR «EUUS» – EURODOLLAR «EUCH» – EuroSwiss «GCFR» – GCF REPO «ISDA» – ISDAFIX «LIBI» – LIBID «LIBO» – LIBOR «MAAA» – Muni AAA «PFAN» – Pfandbriefe «TIBO» – TIBOR «STBO» – STIBOR «BBSW» – BBSW	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		«JIBA» – JIBAR «BUBO» – BUBOR «CDOR» – CDOR «CIBO» – CIBOR «MOSP» – MOSPRIM «NIBO» – NIBOR «PRBO» – PRIBOR «TLBO» – TELBOR «WIBO» – WIBOR «TREA» – Trésor «SWAP» – Contrats d'échange «FUSW» – Contrats d'échange à terme ( <i>future SWAP</i> ) ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas dans la liste ci-dessus.	
56	Période de référence du taux variable de la jambe 1 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
57	Période de référence du taux variable de la jambe 1 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
58	Taux variable de la jambe 2	Nom de l'indice du taux variable: «EONA» – EONIA «EONS» – EONIA SWAP «EURI» – EURIBOR «EUUS» – EURODOLLAR «EUCH» – EuroSwiss «GCFR» – GCF REPO «ISDA» – ISDAFIX «LIBI» – LIBID «LIBO» – LIBOR «MAAA» – Muni AAA «PFAN» – Pfandbriefe «TIBO» – TIBOR «STBO» – STIBOR «BBSW» – BBSW «JIBA» – JIBAR «BUBO» – BUBOR «CDOR» – CDOR «CIBO» – CIBOR «MOSP» – MOSPRIM «NIBO» – NIBOR «PRBO» – PRIBOR	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		«TLBO» – TELBOR «WIBO» – WIBOR «TREA» – Trésor «SWAP» – Contrats d'échange «FUSW» – Contrats d'échange à terme ( <i>future SWAP</i> ) ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas dans la liste ci-dessus.	
59	Période de référence du taux variable de la jambe 2 – Unité de temps	Unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Les abréviations suivantes sont utilisées: Y = année ( <i>year</i> ) M = mois W = semaine ( <i>week</i> ) D = jour ( <i>day</i> )	
60	Période de référence du taux variable de la jambe 2 – Multiplicateur	Multiple entier de l'unité de temps utilisée pour décrire la période de référence. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
	Section 2 g – Changes		Dérivés sur devises
61	Monnaie de livraison 2	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques	
62	Taux de change 1	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
63	Taux de change à terme	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
64	Base du taux de change	Deux codes monnaie ISO 4217, séparés par le symbole «/». Le premier code monnaie désigne la monnaie de base, et le second la monnaie de cotation.	
	Section 2 h – Matières premières et quotas d'émission		Dérivés sur matières premières et quotas d'émission
	Généralités		
65	Catégorie de matière première	AG = matières premières agricoles EN = énergie	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		FR = fret ME = métaux IN = indice EV = environnement EX = matières premières exotiques OT = autre ( <i>other</i> )	
66	Détail des catégories de matières premières	<p><i>Matières premières agricoles</i></p> <p>GO = céréales, oléagineux (<i>grains, oilseeds</i>) DA = produits laitiers (<i>dairy</i>) LI = bétail (<i>livestock</i>) FO = sylviculture (<i>forestry</i>) SO = produits non durables (<i>softs</i>) SF = produits de la mer (<i>seafood</i>) OT = autre (<i>other</i>)</p> <p><i>Énergie</i></p> <p>OI = pétrole (<i>oil</i>) NG = gaz naturel (<i>natural gaz</i>) CO = charbon (<i>coal</i>) EL = électricité IE = interénergies OT = autre (<i>other</i>)</p> <p><i>Fret</i></p> <p>DR = sec (<i>dry</i>) WT = humide (<i>wet</i>) OT = autre (<i>other</i>)</p> <p><i>Métaux</i></p> <p>PR = précieux NP = non précieux</p> <p><i>Environnement</i></p> <p>WE = météo (<i>weather</i>) EM = émissions OT = autre (<i>other</i>)</p>	
	Énergie		
67	Point ou zone de livraison	EIC ( <i>energy identification code</i> ) à 16 caractères alphanumériques Champ répétable	
68	Point d'interconnexion	EIC ( <i>energy identification code</i> ) à 16 caractères alphanumériques	
69	Type de charge	BL = charge de base ( <i>base load</i> ) PL = charge maximale ( <i>peak load</i> ) OP = hors période de pointe ( <i>off-peak</i> ) BH = heures/bloc d'heures SH = shaped GD = journée gazière OT = autre ( <i>other</i> )	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
	Section répétable des champs 70 à 77		
70	Intervalles de livraison de la charge	hh:mmZ	
71	Date et heure de début de livraison	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	
72	Date et heure de fin de livraison	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ	
73	Durée	N = minutes H = heure D = jour ( <i>day</i> ) W = semaine ( <i>week</i> ) M = mois Q = trimestre ( <i>quarter</i> ) S = saison Y = année ( <i>year</i> ) O = autre ( <i>other</i> )	
74	Jour de la semaine	WD = jours de la semaine ( <i>weekdays</i> ) WN = Weekend MO = lundi ( <i>Monday</i> ) TU = mardi ( <i>Tuesday</i> ) WE = mercredi ( <i>Wednesday</i> ) TH = jeudi ( <i>Thursday</i> ) FR = vendredi ( <i>Friday</i> ) SA = samedi ( <i>Saturday</i> ) SU = dimanche ( <i>Sunday</i> ) Plusieurs valeurs possibles, séparées par «/».	
75	Capacité de livraison	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
76	Unité de quantité	KW KWh/h KWh/jour MW MWh/h MWh/jour GW GWh/h GWh/jour	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		Therm/jour KTherm/jour MTherm/jour M <sup>3</sup> /jour Mio m <sup>3</sup> /jour	
77	Prix par quantité par intervalle de temps de livraison	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.	
	Section 2 i – Options		Contrats contenant une option
78	Type d'option	P = Put (option de vente) C = Call (option d'achat) O = si la nature de l'option (achat ou vente) ne peut être déterminée	
79	Modalités d'exercice de l'option	A = américaine B = bermudienne E = européenne S = asiatique Plusieurs valeurs possibles	
80	Prix d'exercice (taux plafond/plancher)	Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique. Lorsque le prix d'exercice est indiqué en pourcentage, le pourcentage est exprimé de telle sorte que 100 % est représenté par «100».	
81	Notation du prix d'exercice	U = unités P = pourcentage Y = rendement ( <i>yield</i> )	
82	Date d'échéance du sous-jacent	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)	
	Section 2 j – Dérivés de crédit		
83	Rang	SNDB = dette senior, telle que dette de premier rang non garantie (entreprises/établissements financiers) ou dette souveraine en devises (administration publique)	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		SBOD = dette subordonnée, telle que dette subordonnée ou de catégorie 2 inférieure (banques), ou telle que dette subordonnée de second rang ou de catégorie 2 supérieure (banques) OTHR = autre, tel qu'actions privilégiées, fonds propres de catégorie 1 (banques) ou autres dérivés de crédit	
84	Entité de référence	Code pays ISO 3166 à 2 caractères ou code pays ISO 3166-2 à 2 caractères suivi d'un tiret «-» et du code de subdivision du pays comptant jusqu'à 3 caractères alphanumériques ou identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques	
85	Fréquence de paiement	MNTH = mensuelle ( <i>monthly</i> ) QURT = trimestrielle ( <i>quarterly</i> ) MIAN = semestrielle ( <i>semi-annually</i> ) YEAR = annuelle ( <i>yearly</i> )	
86	Base de calcul	Numérateur/dénominateur où tant le numérateur que le dénominateur sont exprimés en caractères numériques ou par l'expression alphabétique «Actual», par exemple 30/360 ou Actual/365.	
87	Série	Nombre entier de 5 caractères maximum	
88	Version	Nombre entier de 5 caractères maximum	
89	Facteur d'indice	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.	
90	Tranche	T = subdivision en tranches U = pas de subdivision en tranches ( <i>untranchéd</i> )	
91	Point d'attachement	Jusqu'à 10 caractères numériques, dont décimales exprimées en fraction décimale comprise entre 0 et 1. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.	
92	Point de détachement	Jusqu'à 10 caractères numériques, dont décimales exprimées en fraction décimale comprise entre 0 et 1. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.	
	Section 2 k – Modifications du contrat		
93	Type d'action	N = nouveau M = modification	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		E = erreur C = résiliation anticipée R = correction Z = compression V = actualisation de la valorisation P = composante de la position	
94	Niveau	T = transaction P = position»	