

RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2017/105 DE LA COMMISSION**du 19 octobre 2016****modifiant le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 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****(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)**

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

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

vu le règlement (UE) 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 ⁽¹⁾, et notamment son article 9, paragraphe 6,

considérant ce qui suit:

- (1) Le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission ⁽²⁾ prévoit l'utilisation d'identifiants provisoires d'entité lorsqu'il n'existe pas d'identifiant d'entité juridique, également appelé identifiant d'entité légale. Une infrastructure permettant l'attribution d'identifiants d'entité juridique (LEI) aux entités a été récemment mise en place, et les participants au marché se sont familiarisés avec l'utilisation de ces identifiants. Par conséquent, les identifiants d'entité juridique devraient désormais constituer le seul moyen d'identification autorisé pour les entités juridiques.
- (2) Dans le cas des contrats dérivés d'échange (*swaps*), qui impliquent l'échange d'instruments financiers entre les parties, il est particulièrement complexe de déterminer si la contrepartie déclarante est l'acheteur ou le vendeur. Aussi conviendrait-il d'établir des règles spécifiques permettant de déterminer, de manière précise et cohérente, qui sont les acheteurs et qui les vendeurs dans les contrats dérivés d'échange.
- (3) Afin de déterminer l'exposition réelle des contreparties, les autorités compétentes ont besoin d'informations précises et complètes sur les sûretés (collatéral) échangées entre celles-ci. Il conviendrait, en conséquence, de prévoir des règles spécifiques garantissant une approche cohérente en matière de déclaration des sûretés constituées pour un contrat dérivé ou un portefeuille donné.
- (4) Il est nécessaire d'identifier et de classer précisément les produits dérivés pour pouvoir utiliser efficacement les données y afférentes, agréger utilement les données dont disposent les différents référentiels centraux et contribuer ainsi à la réalisation des objectifs énoncés par le Conseil de stabilité financière dans son étude de faisabilité du 19 septembre 2014 concernant la possibilité d'agréger les données communiquées aux référentiels centraux sur les produits dérivés de gré à gré ⁽³⁾. Il conviendrait donc de modifier les exigences de déclaration relatives à l'identification et à la classification des produits dérivés, de façon à permettre aux autorités compétentes de disposer de l'entièreté de ces informations.
- (5) Il y aurait lieu d'ajouter les options d'échange (*swaptions*) et les spéculations sur écart (*spreadbets*) à la liste des catégories de contrats dérivés, afin que ces nouveaux types de contrats dérivés, qui sont désormais disponibles et couramment négociés grâce à l'innovation financière, puissent être déclarés. Plus généralement, l'innovation financière donnant continuellement naissance à de nouveaux types de contrats dérivés, il importe de veiller à ce que tout contrat dérivé d'un nouveau type qui n'entre pas dans une catégorie existante puisse néanmoins être déclaré. Dès lors, il convient de maintenir la catégorie «autre» dans la classification des types de contrats dérivés.
- (6) Si deux contreparties ne peuvent s'entendre sur celle d'entre elles qui devrait générer l'identifiant de transaction unique dans le délai de déclaration prévu, il peut se révéler impossible d'identifier correctement et d'associer les deux déclarations relatives à la même transaction. Il est donc nécessaire d'édicter des critères pour la production des identifiants de transaction uniques, de manière que la même transaction ne puisse être comptée deux fois.

⁽¹⁾ JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.

⁽²⁾ 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).

⁽³⁾ http://www.fsb.org/wp-content/uploads/r_140919.pdf

- (7) Les contreparties peuvent se heurter à d'importantes difficultés lorsqu'il leur faut recueillir toutes les informations utiles sur les transactions qui se sont closes avant la date d'ouverture de la période de déclaration. Étant donné qu'il est dès lors très complexe de déclarer les transactions closes et que, par ailleurs, celles-ci n'accroissent pas le risque systémique, il conviendrait de porter de 3 à 5 ans le délai dans lequel les transactions closes doivent être déclarées, à compter de la date à partir de laquelle la déclaration est obligatoire.
- (8) Afin de garantir la pleine harmonisation des données déclarées aux référentiels centraux, de façon à permettre une interprétation et une agrégation cohérentes de ces données, il conviendrait de préciser les normes et les formats à utiliser dans les déclarations de transactions. Il y a lieu également de modifier les exigences relatives aux formats de données. Il faudrait laisser aux contreparties et aux référentiels centraux suffisamment de temps pour prendre toute mesure nécessaire pour se conformer aux exigences modifiées.
- (9) Le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 devrait être modifié en conséquence.
- (10) Le présent règlement se fonde sur le projet de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF).
- (11) Conformément à l'article 15 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾, l'AEMF a mené des consultations publiques ouvertes sur ce projet de normes techniques d'exécution, analysé les coûts et avantages potentiels qu'il implique et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier visé à l'article 37 de ce règlement,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

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

- 1) l'article 3 est remplacé par le texte suivant:

«Article 3

Identification des contreparties et des autres entités

Les déclarations utilisent un identifiant d'entité juridique pour identifier:

- a) un bénéficiaire qui est une entité juridique;
- b) une entité de courtage;
- c) une contrepartie centrale;
- d) un membre compensateur;
- e) une contrepartie qui est une entité juridique;
- f) une entité chargée de la transmission des déclarations.»

- 2) les articles 3 bis et 3 ter suivants sont insérés:

«Article 3 bis

Côté de la contrepartie

1. Le côté de la contrepartie au contrat dérivé visé dans le champ 14 du tableau 1 de l'annexe est déterminé conformément aux paragraphes 2 à 10.
2. Dans le cas des options et des options d'échange (*swaptions*), la contrepartie qui détient le droit d'exercer l'option est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend l'option et reçoit une prime, comme le vendeur.

⁽¹⁾ Règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers), modifiant la décision n° 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

3. Dans le cas des *futures* (contrats à terme négociés sur un marché réglementé) et des *forwards* (contrats à terme négociés de gré à gré) autres que les *futures* et les *forwards* portant sur des devises, la contrepartie qui achète l'instrument est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend l'instrument, comme le vendeur.
4. Dans le cas des contrats d'échange (*swaps*) portant sur des titres, la contrepartie qui accepte le risque de variation du prix du titre sous-jacent et reçoit le montant du titre est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui paie le montant du titre, comme le vendeur.
5. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des taux d'intérêt ou des indices d'inflation, la contrepartie qui paie le taux fixe est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui reçoit le taux fixe, comme le vendeur. Dans le cas des contrats d'échange taux d'intérêt variable contre taux d'intérêt variable (*basis swap* ou *swap de base*), la contrepartie qui paie l'écart de taux est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui reçoit l'écart de taux, comme le vendeur.
6. Dans le cas des crédits croisés (*cross-currency swaps*) et des contrats d'échange et *forwards* portant sur des devises, la contrepartie qui reçoit la devise venant en premier dans l'ordre alphabétique selon la norme ISO 4217 de l'Organisation internationale de normalisation (ISO) est identifiée comme le vendeur, et la contrepartie qui livre cette devise, comme l'acheteur.
7. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des dividendes, la contrepartie qui reçoit l'équivalent des dividendes effectivement distribués est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui paie le dividende et reçoit le taux fixe, comme le vendeur.
8. Dans le cas des instruments dérivés servant au transfert du risque de crédit, à l'exception des options et des options d'échange, la contrepartie qui achète la protection est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend la protection, comme le vendeur.
9. Dans le cas des contrats dérivés portant sur des matières premières, la contrepartie qui reçoit la matière première indiquée dans la déclaration est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui livre cette matière première, comme le vendeur.
10. Dans le cas des accords de taux futurs, la contrepartie qui paie le taux fixe est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui reçoit le taux fixe, comme le vendeur.

Article 3 ter

Couverture par des sûretés (collatéralisation)

1. Le type de collatéralisation employé pour le contrat dérivé, visé dans le champ 21 du tableau 1 de l'annexe, est identifié par la contrepartie déclarante conformément aux paragraphes 2 à 5.
2. Lorsqu'il n'existe aucun accord de sûreté (collatéral) entre les contreparties ou lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante ne fournit pas de marge initiale ni de marge de variation pour le contrat dérivé, celui-ci est identifié comme non collatéralisé dans le champ "type de collatéralisation".
3. Lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante ne fournit régulièrement que des marges de variation pour le contrat dérivé, celui-ci est identifié comme partiellement collatéralisé dans le champ "type de collatéralisation".
4. Lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante fournit la marge initiale et fournit régulièrement des marges de variation et que l'autre contrepartie soit ne fournit que des marges de variation, soit ne fournit aucune marge pour le contrat dérivé, celui-ci est identifié comme collatéralisé à sens unique dans le champ "type de collatéralisation".
5. Lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que les deux contreparties fournissent une marge initiale et fournissent régulièrement des marges de variation pour le contrat dérivé, celui-ci est identifié comme pleinement collatéralisé dans le champ "type de collatéralisation".»

3) l'article 4 est remplacé par le texte suivant:

«Article 4

Spécification, identification et classification des produits dérivés

1. Les déclarations spécifient les produits dérivés sur la base du type de contrat et de la catégorie d'actifs, conformément aux paragraphes 2 et 3.

2. Le produit dérivé est spécifié dans le champ 1 du tableau 2 de l'annexe comme correspondant à l'un des types de contrats suivants:

- a) contrat financier avec paiement d'un différentiel;
- b) accord de taux futur;
- c) *forward*;
- d) *future*;
- e) option;
- f) spéculation sur écart (*spreadbet*);
- g) contrat d'échange;
- h) option d'échange (*swaption*);
- i) autre.

3. Le produit dérivé est spécifié dans le champ 2 du tableau 2 de l'annexe comme correspondant à l'une des catégories d'actifs suivantes:

- a) matières premières et quotas d'émission;
- b) crédit;
- c) devise;
- d) actions;
- e) taux d'intérêt.

4. Lorsque le produit dérivé n'entre dans aucune des catégories d'actifs spécifiées au paragraphe 3, les contreparties indiquent dans leur déclaration la catégorie d'actifs dont le produit dérivé se rapproche le plus. Les deux contreparties indiquent la même catégorie d'actifs.

5. Le produit dérivé est identifié dans le champ 6 du tableau 2 de l'annexe selon les codes suivants, lorsqu'ils existent:

- a) un numéro international d'identification des valeurs mobilières (code ISIN, norme ISO 6166) ou un code AII (*Alternative Instrument Identifier*), selon le cas, jusqu'à la date d'application de l'acte délégué adopté par la Commission en vertu de l'article 27, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil (*);
- b) un code ISIN, à compter de la date d'application de l'acte délégué adopté par la Commission en vertu de l'article 27, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 600/2014.

Lorsqu'un code AII est utilisé, le code complet est indiqué.

6. Le code AII complet visé au paragraphe 5 résulte de la concaténation des six éléments suivants:

- a) le code d'identification de marché (MIC, norme ISO 10383) de la plateforme de négociation où le produit dérivé est négocié, qui se compose de 4 caractères alphanumériques;
- b) le code spécifique correspondant à un sous-jacent particulier, un type de règlement donné et d'autres caractéristiques du contrat, qui est attribué par la plateforme de négociation et comprend jusqu'à 12 caractères alphanumériques;

- c) le caractère unique indiquant si l'instrument est une option ou un *future*, consistant en un «O» dans le cas d'une option et en un «F» dans le cas d'un *future*;
- d) le caractère unique indiquant si l'option est une option de vente (*put*) ou d'achat (*call*), consistant en un «P» dans le cas d'un *put* et en un «C» dans le cas d'un *call*; lorsque l'instrument a été identifié comme un *future* conformément au point c), il est désigné par un F;
- e) la date d'exercice ou la date d'échéance du contrat dérivé, au format AAAA-MM-JJ de la norme ISO 8601;
- f) le prix d'exercice d'une option, indiqué en utilisant jusqu'à 19 chiffres, y compris jusqu'à cinq décimales, sans zéro initial ni final. Le séparateur décimal à utiliser est le point. Les valeurs négatives ne sont pas autorisées. Lorsque l'instrument est un *future*, la valeur indiquée dans le champ du prix d'exercice est zéro.

7. Les produits identifiés par un code ISIN ISO 6166 ou un code AII sont en outre classés dans le champ 4 du tableau 2 de l'annexe selon un code de classification des instruments financiers (code CFI, norme ISO 10692).

8. Les produits dérivés pour lesquels il n'existe pas de code ISIN ISO 6166 ou de code AII sont classés au moyen d'un code désigné. Ce code est:

- a) unique;
- b) neutre;
- c) fiable;
- d) à source ouverte;
- e) extensible;
- f) accessible;
- g) disponible à un coût raisonnable;
- h) soumis à un cadre de gouvernance approprié.

9. En attendant que le code visé au paragraphe 8 ait été approuvé par l'AEMF, les produits dérivés pour lesquels il n'existe pas de code ISIN ISO 6166 ou de code AII sont classés au moyen d'un code CFI ISO 10692.

(*) Règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 (JO L 173 du 12.6.2014, p. 84).»

4) les articles 4 *bis* et 4 *ter* suivants sont insérés:

«Article 4 bis

Identifiant de transaction unique

1. Les déclarations sont identifiées au moyen soit d'un identifiant de transaction unique global approuvé par l'AEMF ou, en l'absence d'un tel identifiant, au moyen d'un identifiant de transaction unique convenu par les contreparties.

2. Lorsqu'elles ne s'accordent pas sur l'entité à qui il incombe de générer l'identifiant de transaction unique à assigner à la déclaration, les contreparties déterminent ladite entité conformément aux principes suivants:

- a) pour les transactions faisant l'objet d'une exécution et d'une compensation centralisées, l'identifiant de transaction unique est généré au point de compensation par la contrepartie centrale pour le membre compensateur. Un autre identifiant de transaction unique est généré par le membre compensateur pour sa contrepartie;
- b) pour les transactions faisant l'objet d'une exécution centralisée, mais non d'une compensation centralisée, l'identifiant de transaction unique est généré par la plateforme de négociation où a lieu l'exécution pour son membre;

- c) pour les transactions faisant l'objet d'une confirmation et d'une compensation centralisées, l'identifiant de transaction unique est généré au point de compensation par la contrepartie centrale pour le membre compensateur. Un autre identifiant de transaction unique est généré par le membre compensateur pour sa contrepartie;
 - d) pour les transactions qui sont confirmées de manière centralisée par voie électronique, mais qui ne font pas l'objet d'une compensation centralisée, l'identifiant de transaction unique est généré par la plateforme de confirmation des transactions au point de confirmation;
 - e) pour toutes les transactions autres que celles visées aux points a) à d), les dispositions suivantes s'appliquent:
 - i) lorsque des contreparties financières négocient avec des contreparties non financières, l'identifiant de transaction unique est généré par les contreparties financières;
 - ii) lorsque des contreparties non financières qui dépassent le seuil de compensation négocient avec des contreparties non financières qui ne dépassent pas ce seuil, l'identifiant de transaction unique est généré par les contreparties non financières qui dépassent le seuil de compensation;
 - iii) pour toutes les transactions autres que celles visées aux points i) et ii), l'identifiant de transaction unique est généré par le vendeur.
3. La contrepartie générant l'identifiant de transaction unique communique celui-ci à l'autre contrepartie dans un délai suffisamment court pour permettre à cette dernière de s'acquitter de son obligation de déclaration.

Article 4 ter

Lieu d'exécution

Le lieu d'exécution du contrat dérivé est identifié dans le champ 15 du tableau 2 de l'annexe, comme suit:

- a) jusqu'à la date d'application de l'acte délégué adopté par la Commission en vertu de l'article 27, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 600/2014:
 - i) un lieu d'exécution situé dans l'Union est identifié par le code d'identification de marché (MIC, norme ISO 10383) publié sur le site web de l'AEMF, dans le registre constitué sur la base des informations communiquées par les autorités compétentes conformément à l'article 13, paragraphe 2, du règlement (CE) n° 1287/2006 de la Commission (*);
 - ii) un lieu d'exécution situé en dehors de l'Union est identifié par le code d'identification de marché (MIC, norme ISO 10383) inscrit sur la liste des codes d'identification de marché établie, tenue à jour et publiée par l'ISO sur son site web;
- b) à compter de la date d'application de l'acte délégué adopté par la Commission en vertu de l'article 27, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 600/2014, le lieu d'exécution est identifié par le code d'identification de marché (MIC, norme ISO 10383).

(*) Règlement (CE) n° 1287/2006 de la Commission du 10 août 2006 portant mesures d'exécution de la directive 2004/39/CE du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les obligations des entreprises d'investissement en matière d'enregistrement, le compte rendu des transactions, la transparence du marché, l'admission des instruments financiers à la négociation et la définition de termes aux fins de ladite directive (JO L 241 du 2.9.2006, p. 1).»

- 5) à l'article 5, le paragraphe 4 est remplacé par le texte suivant:

«4. Les contrats dérivés suivants qui ne sont pas en cours à la date d'ouverture de la période de déclaration pour la catégorie de dérivés concernée sont déclarés auprès d'un référentiel central au plus tard cinq ans après cette date:

- a) les contrats dérivés qui ont été conclus avant le 16 août 2012 et qui étaient toujours en cours le 16 août 2012;
- b) les contrats dérivés qui ont été conclus le 16 août 2012 ou après cette date.»

- 6) l'annexe est remplacée par le texte figurant à l'annexe du présent règlement.

Article 2

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

Il s'applique à compter du 1^{er} novembre 2017, à l'exception de son article 1^{er}, paragraphe 5, qui s'applique à compter de sa date d'entrée en vigueur.

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

Fait à Bruxelles, le 19 octobre 2016.

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE

«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 légale (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
3	Type d'identifiant de l'autre contrepartie	"LEI", pour l'identifiant d'entité légale de la norme ISO 17442. "CLC", pour un code client.
4	Identifiant de l'autre contrepartie	Identifiant d'entité légale (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>Taxonomie pour les contreparties financières:</p> <p>A = une entreprise d'assurance vie agréée conformément à la directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾;</p> <p>C = un établissement de crédit agréé conformément à la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽²⁾;</p> <p>F = une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive 2004/39/CE du Parlement européen et du Conseil ⁽³⁾;</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 ⁽⁴⁾;</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 ⁽⁵⁾;</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 ⁽⁶⁾.</p> <p>Taxonomie pour les 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 ⁽⁷⁾:</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
		<p>5 = Production et distribution d'eau, assainissement, gestion des déchets et dépollution</p> <p>6 = Construction</p> <p>7 = Commerce; réparation d'automobiles et de motocycles</p> <p>8 = Transport et entreposage</p> <p>9 = Hébergement et restauration</p> <p>10 = Information et communication</p> <p>11 = Activités financières et d'assurance</p> <p>12 = Activités immobilières</p> <p>13 = Activités spécialisées, scientifiques et techniques</p> <p>14 = Activités de services administratifs et de soutien</p> <p>15 = Administration publique</p> <p>16 = Enseignement</p> <p>17 = Santé humaine et action sociale</p> <p>18 = Arts, spectacles et activités récréatives</p> <p>19 = Autres activités de services</p> <p>20 = Activités des ménages en tant qu'employeurs; activités indifférenciées des ménages en tant que producteurs de biens et services pour usage propre</p> <p>21 = Activités extraterritoriales</p> <p>Lorsque plusieurs activités sont déclarées, lister les codes par ordre d'importance relative des activités correspondantes, en les séparant par un tiret "-".</p> <p>Laisser la case vierge pour les contreparties centrales et les autres types de contreparties visés à l'article 1^{er}, paragraphe 5, du règlement (UE) n° 648/2012.</p>
7	Nature de la contrepartie déclarante	<p>F = contrepartie financière</p> <p>N = contrepartie non financière</p> <p>C = contrepartie centrale</p> <p>O = autre</p>
8	Identifiant du courtier	Identifiant d'entité légale (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
9	Identifiant de l'entité qui soumet la déclaration	Identifiant d'entité légale (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
10	Identifiant du membre compensateur	Identifiant d'entité légale (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
11	Type d'identifiant du bénéficiaire	<p>"LEI", pour l'identifiant d'entité légale de la norme ISO 17442.</p> <p>"CLC", pour un code client.</p>
12	Identifiant du bénéficiaire	Identifiant d'entité légale (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 légale.

	Champ	Format
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.
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-DDThh: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 ter.
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.

	Champ	Format
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
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 = <i>future</i> FW = <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>)	
2	Catégorie d'actif	CO = matières premières et quotas d'émission (<i>commodity and emission allowances</i>) CR = crédit CU = devise (<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>) U = UPI (<i>unique product identifier</i> , identifiant de produit unique)	
4	Classification du produit	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques. UPI approuvé.	
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 conformément à l'article 4, paragraphe 8.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
7	Type d'identification du sous-jacent	I = code ISIN A = code AII (<i>Alternative Instrument Identifier</i>) U = UPI (<i>unique product identifier</i> , identifiant de produit unique) 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 conformément à l'article 4, paragraphe 8. Pour un identifiant du sous-jacent de type U: UPI. Pour un identifiant du sous-jacent de type B: code ISIN ISO 6166 ou code AII complet conformément à l'article 4, paragraphe 8, 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	En attendant qu'un identifiant de transaction unique mondial soit disponible, 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.	
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> .	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
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 d'exercice 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-DDThh:mm:ssZ	
26	Date effective	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.	
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-DDThh: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	Compensé	Y = Oui N = Non	
36	Horodatage de la compensation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ	
37	Contrepartie centrale	Identifiant d'entité légale (LEI) de la norme ISO 17442. 20 caractères alphanumériques.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
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, exprimées 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.	
40	Taux fixe de la jambe 2	Jusqu'à 10 caractères numériques, décimales comprises, exprimées 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 — Période de temps	Période de temps indiquant 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>)	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
44	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 — Multiplificateur	Multiple entier de la période de temps indiquant 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 — Période de temps	Période de temps indiquant 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 — Multiplificateur	Multiple entier de la période de temps indiquant la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
47	Fréquence de paiement du taux flottant de la jambe 1 — Période de temps	Période de temps indiquant 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 flottant de la jambe 1 — Multiplificateur	Multiple entier de la période de temps indiquant la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
49	Fréquence de paiement du taux flottant de la jambe 2 — Période de temps	Période de temps indiquant 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 flottant de la jambe 2 — Multiplificateur	Multiple entier de la période de temps indiquant la fréquence des échanges de paiements entre les contreparties. Jusqu'à 3 caractères numériques.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
51	Fréquence de réinitialisation du taux flottant de la jambe 1 — Période de temps	Période de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties réinitialisent le taux flottant. 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 réinitialisation du taux flottant de la jambe 1 — Multiplicateur	Multiple entier de la période de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties réinitialisent le taux flottant. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
53	Fréquence de réinitialisation du taux flottant de la jambe 2 — Période de temps	Période de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties réinitialisent le taux flottant. 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 réinitialisation du taux flottant de la jambe 2 — Multiplicateur	Multiple entier de la période de temps indiquant la fréquence à laquelle les contreparties réinitialisent le taux flottant. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
55	Taux variable de la jambe 1	Nom de l'indice du taux flottant: "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	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		"CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — Treasury "SWAP" — SWAP "FUSW" — Future SWAP ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas sur la liste ci-dessus.	
56	Période de référence du taux flottant de la jambe 1 — Période de temps	Période de temps correspondant à 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 flottant de la jambe 1 — Multiplicateur	Multiple entier de la période de temps correspondant à la période de référence. Jusqu'à 3 caractères numériques.	
58	Taux variable de la jambe 2	Nom de l'indice du taux flottant: "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	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
		"NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — Treasury "SWAP" — SWAP "FUSW" — Future SWAP ou jusqu'à 25 caractères alphanumériques si l'indice de référence ne figure pas sur la liste ci-dessus.	
59	Période de référence du taux flottant de la jambe 2 — Période de temps	Période de temps correspondant à 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 flottant de la jambe 2 — Multiplicateur	Multiple entier de la période de temps correspondant à 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 futur	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.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
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 = matières premières énergétiques FR = fret ME = métaux IN = indice EV = matières premières environnementales EX = matières premières exotiques OT = autre (<i>other</i>)	
66	Détail des catégories de matières premières	Matières premières agricoles GO = céréales, oléagineux (<i>grains, oilseeds</i>) DA = produits laitiers (<i>dairy</i>) LI = animaux (<i>livestock</i>) FO = sylviculture (<i>forestry</i>) SO = non durables (<i>softs</i>) SF = produits de la mer (<i>seafood</i>) OT = autre (<i>other</i>) Matières premières énergétiques 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>) Fret DR = sec (<i>dry</i>) WT = humide (<i>wet</i>) OT = autre (<i>other</i>) Métaux PR = précieux NP = non précieux Environnement WE = météo (<i>weather</i>) EM = émissions OT = autre (<i>other</i>)	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
	Matières premières énergétiques		
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>)	
	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-DDThh:mm:ssZ	
72	Date et heure de fin de livraison	Date et heure TUC au format ISO 8601, 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 "/".	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
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 Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
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	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
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) 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 légale (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.	

	Champ	Format	Types de contrats dérivés concernés
87	Séries	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>untranché</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 i — Modifications du contrat		
93	Type d'action	N = nouveau M = modification 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»	