

Bruxelles, le 17 juin 2022
(OR. en)

10384/22
ADD 1

EF 178
ECOFIN 637
DELECT 97

NOTE DE TRANSMISSION

Origine:	Pour la secrétaire générale de la Commission européenne, Madame Martine DEPREZ, directrice
Destinataire:	Secrétariat général du Conseil
N° doc. Cion:	C(2022) 3581 final - ANNEXE
Objet:	ANNEXE du RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ DE LA COMMISSION (UE) .../... complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les procédures de rapprochement des données entre référentiels centraux et les procédures à appliquer par le référentiel central pour vérifier le respect des obligations de déclaration par la contrepartie déclarante ou par l'entité qui soumet la déclaration et pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des données déclarées

Les délégations trouveront ci-joint le document C(2022) 3581 final - ANNEXE.

p.j.: C(2022) 3581 final - ANNEXE

Bruxelles, le 10.6.2022
C(2022) 3581 final

ANNEX

ANNEXE

du

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ DE LA COMMISSION (UE) .../...

complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les procédures de rapprochement des données entre référentiels centraux et les procédures à appliquer par le référentiel central pour vérifier le respect des obligations de déclaration par la contrepartie déclarante ou par l'entité qui soumet la déclaration et pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des données déclarées

ANNEXE

Tableau 1

Motifs de rejet d'une déclaration de produit dérivé

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

Tableau 2

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
1	Parties au produit dérivé	Horodatage de la déclaration	S.O.	S.O.
2	Parties au produit dérivé	Identifiant de l'entité qui soumet la déclaration	S.O.	S.O.
3	Parties au produit dérivé	Entité responsable de la déclaration	S.O.	S.O.
4	Parties au produit dérivé	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Idem que champ 9 du présent tableau	Date du début de l'obligation de déclaration
5	Parties au produit dérivé	Nature de la contrepartie 1	S.O.	S.O.
6	Parties au produit dérivé	Secteur d'activité de la contrepartie 1	S.O.	S.O.

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
7	Parties au produit dérivé	Seuil de compensation de la contrepartie 1	S.O.	S.O.
8	Parties au produit dérivé	Type d'identifiant de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
9	Parties au produit dérivé	Contrepartie 2	Idem que champ 4 du présent tableau	Date du début de l'obligation de déclaration
10	Parties au produit dérivé	Pays de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
11	Parties au produit dérivé	Nature de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
12	Parties au produit dérivé	Secteur d'activité de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
13	Parties au produit dérivé	Seuil de compensation de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
14	Parties au produit dérivé	Obligation de déclaration de la contrepartie 2	S.O.	S.O.
15	Parties au produit dérivé	Identifiant du courtier	S.O.	S.O.
16	Parties au produit dérivé	Membre compensateur	S.O.	S.O.
17	Parties au produit dérivé	Sens	Opposé	Date du début de l'obligation de déclaration
18	Parties au produit dérivé	Sens de la jambe 1	Opposé	Date du début de l'obligation de déclaration
19	Parties au produit dérivé	Sens de la jambe 2	Opposé	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
20	Parties au produit dérivé	Lien direct avec l'activité commerciale ou le financement de trésorerie	S.O.	S.O.
1	Section 2a – Identifiants et liens	UTI	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
2	Section 2a – Identifiants et liens	Numéro de suivi de la déclaration	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
3	Section 2a – Identifiants et liens	UTI antérieur (pour les relations «un-à-un» et «un-à-plusieurs» entre les transactions)	Non	Deux ans après la date du début de l'obligation de déclaration
4	Section 2a – Identifiants et liens	UTI de la position ultérieure	Non	Deux ans après la date du début de l'obligation de déclaration
5	Section 2a – Identifiants et liens	Identifiant de la réduction des risques post-négociation	S.O.	S.O.
6	Section 2a – Identifiants et liens	Identifiant du groupe	S.O.	S.O.
7	Section 2b – Informations contractuelles	Numéro international d'identification des titres (code ISIN)	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
8	Section 2b – Informations contractuelles	Identifiant de produit unique (UPI)	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
9	Section 2b – Informations contractuelles	Classification du produit	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
10	Section 2b – Informations contractuelles	Type de contrat	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
11	Section 2b – Informations contractuelles	Catégorie d'actifs	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
12	Section 2b – Informations contractuelles	Produit dérivé fondé sur des crypto-actifs	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
13	Section 2b – Informations contractuelles	Type d'identification du sous-jacent	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
14	Section 2b – Informations contractuelles	Identification du sous-jacent	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
15	Section 2b – Informations contractuelles	Indicateur de l'indice sous-jacent	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
16	Section 2b – Informations contractuelles	Nom de l'indice sous-jacent	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
17	Section 2b – Informations contractuelles	Code du panier personnalisé	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
18	Section 2b – Informations contractuelles	Identifiant des composants du panier	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
19	Section 2b – Informations contractuelles	Monnaie de règlement 1	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
20	Section 2b – Informations contractuelles	Monnaie de règlement 2	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
21	Section 2c – Valorisation	Montant de la valorisation	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
22	Section 2c – Valorisation	Monnaie de la valorisation	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
23	Section 2c – Valorisation	Horodatage de la valorisation	S.O.	S.O.
24	Section 2c – Valorisation	Méthode de valorisation	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
25	Section 2c – Valorisation	Delta	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
26	Section 2d – Sûretés	Indicateur du portefeuille de sûretés	S.O.	S.O.
27	Section 2d – Sûretés	Code du portefeuille de sûretés	S.O.	S.O.
28	Section 2e – Réduction des risques, déclaration	Horodatage de la confirmation	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
29	Section 2e – Réduction des risques, déclaration	Confirmé	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
30	Section 2f – Compensation	Obligation de compensation	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
31	Section 2f – Compensation	Compensé	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
32	Section 2f – Compensation	Horodatage de la compensation	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
33	Section 2f – Compensation	Contrepartie centrale	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
34	Section 2g – Détails de la transaction	Type de convention-cadre	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
35	Section 2g – Détails de la transaction	Autre type de convention-cadre	S.O.	S.O.
36	Section 2g – Détails de la transaction	Version de la convention-cadre	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
37	Section 2g – Détails de la transaction	Intragroupe	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
38	Section 2g – Détails de la transaction	Réduction des risques post-négociation	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
39	Section 2g – Détails de la transaction	Type de technique de réduction des risques post-négociation	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
40	Section 2g – Détails de la transaction	Prestataire de services de réduction des risques post-négociation	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
41	Section 2g – Détails de la transaction	Lieu d'exécution	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
42	Section 2c – Détails de la transaction	Horodatage de l'exécution	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
43	Section 2c – Détails de la transaction	Date de prise d'effet	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
44	Section 2c – Détails de la transaction	Date d'expiration	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
45	Section 2c – Détails de la transaction	Date de résiliation anticipée	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
46	Section 2c – Détails de la transaction	Date de règlement contractuel final	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
47	Section 2c – Détails de la transaction	Modalités de livraison	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
48	Section 2g – Détails de la transaction	Prix	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
49	Section 2g – Détails de la transaction	Monnaie du prix	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
50	Section 2g – Détails de la transaction	Date de prise d'effet non ajustée du prix	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
51	Section 2g – Détails de la transaction	Date d'expiration non ajustée du prix	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
52	Section 2g – Détails de la transaction	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet et la date d'expiration non ajustées	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
53	Section 2g – Détails de la transaction	Prix de la transaction groupée	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
54	Section 2g – Détails de la transaction	Monnaie du prix de la transaction groupée	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
55	Section 2g – Détails de la transaction	Montant notionnel de la jambe 1	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
56	Section 2g – Détails de la transaction	Monnaie du notionnel 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
57	Section 2g – Détails de la transaction	Date de prise d'effet du montant notionnel de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
58	Section 2g – Détails de la transaction	Date d'expiration du montant notionnel de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
59	Section 2g – Détails de la transaction	Montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 1	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
60	Section 2g – Détails de la transaction	Quantité notionnelle totale de la jambe 1	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
61	Section 2g – Détails de la transaction	Date de prise d'effet de la quantité notionnelle de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
62	Section 2g – Détails de la transaction	Date d'expiration de la quantité notionnelle de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
63	Section 2g – Détails de la transaction	Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 1	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
64	Section 2g – Détails de la transaction	Montant notionnel de la jambe 2	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
65	Section 2g – Détails de la transaction	Monnaie du notionnel 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
66	Section 2g – Détails de la transaction	Date de prise d'effet du montant notionnel de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
67	Section 2g – Détails de la transaction	Date d'expiration du montant notionnel de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
68	Section 2g – Détails de la transaction	Montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 2	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
69	Section 2g – Détails de la transaction	Quantité notionnelle totale de la jambe 2	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
70	Section 2g – Détails de la transaction	Date de prise d'effet de la quantité notionnelle de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
71	Section 2g – Détails de la transaction	Date d'expiration de la quantité notionnelle de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
72	Section 2g – Détails de la transaction	Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 2	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
73	Section 2g – Détails de la transaction	Autre type de paiement	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
74	Section 2g – Détails de la transaction	Montant des autres paiements	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
75	Section 2g – Détails de la transaction	Monnaie des autres paiements	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
76	Section 2g – Détails de la transaction	Date des autres paiements	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
77	Section 2g – Détails de la transaction	Payeur des autres paiements	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
78	Section 2g – Détails de la transaction	Receveur des autres paiements	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
79	Section 2h – Taux d'intérêt	Taux fixe de la jambe 1 ou coupon	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
80	Section 2h – Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
81	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
82	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
83	Section 2h – Taux d'intérêt	Identifiant du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
84	Section 2h – Taux d'intérêt	Indicateur du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
85	Section 2h – Taux d'intérêt	Nom du taux variable de la jambe 1	S.O.	S.O.
86	Section 2h – Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
87	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
88	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
89	Section 2h – Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 1 – Unité de temps	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
90	Section 2h – Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 1 – Multiplicateur	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
91	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
92	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 1	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
93	Section 2h – Taux d'intérêt	Écart de la jambe 1	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
94	Section 2h – Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart de la jambe 1	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
95	Section 2h – Taux d'intérêt	Taux fixe de la jambe 2	Oui	Date du début de l'obligation de déclaration
96	Section 2h – Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux fixe de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
97	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
98	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
99	Section 2h – Taux d'intérêt	Identifiant du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
100	Section 2h – Taux d'intérêt	Indicateur du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
101	Section 2h – Taux d'intérêt	Nom du taux variable de la jambe 2	S.O.	S.O.
102	Section 2h – Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
103	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
104	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
105	Section 2h – Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 2 – Unité de temps	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
106	Section 2h – Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 2 – Multiplicateur	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
107	Section 2h – Taux d'intérêt	Fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
108	Section 2h – Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 2	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
109	Section 2h – Taux d'intérêt	Écart de la jambe 2	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
110	Section 2h – Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart de la jambe 2	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
111	Section 2h – Taux d'intérêt	Écart de la transaction groupée	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
112	Section 2h – Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart de la transaction groupée	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
113	Section 2i – Devises	Taux de change 1	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
114	Section 2i – Devises	Taux de change à terme	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
115	Section 2i – Devises	Base du taux de change	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
116	Section 2j – Matières premières et quotas d'émission (général)	Catégorie de produit	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
117	Section 2j – Matières premières et quotas d'émission (général)	Sous-catégorie de produit	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
118	Section 2j – Matières premières et quotas d'émission (général)	Produit	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
119	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Point ou zone de livraison	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
120	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Point d'interconnexion	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
121	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Type de charge	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
122	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Heure de début de l'intervalle de livraison	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
123	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Heure de fin de l'intervalle de livraison	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
124	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Date de début de livraison	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
125	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Date de fin de livraison	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
126	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Durée	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
127	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Jours de la semaine	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
128	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Capacité de livraison	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
129	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Unité de mesure	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
130	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Prix par quantité par intervalle de temps de livraison	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
131	Section 2k – Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Monnaie du prix par quantité par intervalle de temps de livraison	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
132	Section 2l – Options	Type d'option	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
133	Section 2l – Options	Style d'option	Non	Date du début de l'obligation de déclaration
134	Section 2l – Options	Prix d'exercice	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
135	Section 2l – Options	Date de prise d'effet du prix d'exercice	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
136	Section 2l – Options	Date de fin du prix d'exercice	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
137	Section 2l – Options	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
138	Section 2l – Options	Monnaie/paire de monnaies du prix d'exercice	Non	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
139	Section 2l – Options	Montant de la prime de l'option	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
140	Section 2l – Options	Monnaie de la prime de l’option	Non	Deux ans à compter de la date du début de l’obligation de déclaration
141	Section 2l – Options	Date de paiement de la prime de l’option	Non	Deux ans à compter de la date du début de l’obligation de déclaration
142	Section 2l – Options	Date d’échéance du sous-jacent	Non	Date du début de l’obligation de déclaration
143	Section 2m – Dérivés de crédit	Rang	Non	Date du début de l’obligation de déclaration
144	Section 2m – Dérivés de crédit	Entité de référence	Non	Date du début de l’obligation de déclaration
145	Section 2m – Dérivés de crédit	Série	Non	Deux ans à compter de la date du début de l’obligation de déclaration
146	Section 2m – Dérivés de crédit	Version	Non	Deux ans à compter de la date du début de l’obligation de déclaration
147	Section 2m – Dérivés de crédit	Facteur d’indice	Oui	Date du début de l’obligation de déclaration
148	Section 2m – Dérivés de crédit	Tranche	Non	Date du début de l’obligation de déclaration
149	Section 2m – Dérivés de crédit	Point d’attachement de l’indice du contrat d’échange sur risque de crédit (Credit Default Swap ou CDS)	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l’obligation de déclaration

	Section	Champ	Tolérance de rapprochement	Date de début du rapprochement
150	Section 2m – Dérivés de crédit	Point de détachement de l'indice de CDS	Oui	Deux ans à compter de la date du début de l'obligation de déclaration
151	Section 2n – Modifications du produit dérivé	Type d'action	S.O.	S.O.
152	Section 2n – Modifications du produit dérivé	Type d'événement	S.O.	S.O.
153	Section 2n – Modifications du produit dérivé	Date de l'événement	S.O.	S.O.
154	Section 2n – Modifications du produit dérivé	Niveau	Non	Date du début de l'obligation de déclaration

Tableau 3

Catégories	Valeurs pouvant être affectées
Obligation de déclaration pour les deux contreparties	Oui/Non
Type de déclaration	Unilatérale/Bilatérale
Appariement	Apparié/Non-apparié
Rapprochement	Rapproché/Non rapproché
Rapprochement de la valorisation	Rapprochée/Non rapprochée
Repris	Oui/Non
Autres modifications	Oui/Non