RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2020/1225 DE LA COMMISSION

du 29 octobre 2019

établissant des normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et les modèles standardisés à utiliser par l'initiateur, le sponsor et la SSPE pour mettre à disposition les informations et les détails d'une titrisation

(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) 2017/2402 du Parlement européen et du Conseil du 12 décembre 2017 créant un cadre général pour la titrisation ainsi qu'un cadre spécifique pour les titrisations simples, transparentes et standardisées, et modifiant les directives 2009/65/CE, 2009/138/CE et 2011/61/UE et les règlements (CE) n° 1060/2009 et (UE) n° 648/2012 ([1]), et notamment son article 7, paragraphe 4, et son article 17, paragraphe 3,

considérant ce qui suit:

(1) L'article 7, paragraphe 4, du règlement (UE) 2017/2402 concerne toutes les titrisations, qu'il s'agisse des titrisations pour lesquelles un prospectus doit être établi en vertu du règlement (UE) 2017/1129 ([2]) (communément appelées titrisations «publiques») ou des titrisations pour lesquelles l'établissement d'un prospectus n'est pas exigé (communément appelées titrisations «privées»). L'article 17, paragraphe 3, du règlement (UE) 2017/2402 concerne les titrisations pour lesquelles les informations sont mises à disposition par l'intermédiaire d'un référentiel des titrisations, ce qui n'inclut pas les titrisations privées.

(2) Les titrisations sont des opérations complexes et hétérogènes. Afin de permettre une collecte et une évaluation efficaces des données par les investisseurs, les investisseurs potentiels, les autorités compétentes et, dans le cas des titrisations publiques, les autres entités énumérées à l'article 17, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/2402, les informations visées à l'article 7, paragraphe 1, points a) et e), et à l'article 17, paragraphe 2, point a), du règlement (UE) 2017/2402 devraient être mises à disposition dans un format harmonisé. De plus, lorsque les informations sont mises à disposition par l'intermédiaire d'un référentiel des titrisations, un format harmonisé facilite aussi l'agrégation et la comparaison des données entre les différents référentiels.

(3) Il convient de réduire au minimum les coûts pour les participants au marché. Le format pour la déclaration des titrisations devrait donc, dans la mesure du possible, être similaire à 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 ([3]) et pour la déclaration des éléments des opérations de financement sur titres imposée par l'article 4 du règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil ([4]). En outre, lorsque les informations sont mises à disposition par l'intermédiaire d'un référentiel des titrisations, le format de déclaration devrait également tenir compte des solutions développées par les responsables de la collecte de données de titrisation existants. Par conséquent, il convient d'exiger que le format XML, qui est couramment utilisé pour la déclaration d'informations sur les prêts et autres expositions sous-jacentes similaires, soit également utilisé pour la déclaration des titrisations.

(4) Les dispositions du présent règlement sont étroitement liées entre elles, puisqu'elles déterminent le format et les modèles au moyen desquels l'initiateur, le sponsor ou l'entité de titrisation (SSPE) d'une titrisation doivent mettre à la disposition des diverses parties les informations relatives à cette titrisation, en application du règlement (UE) 2017/2402. Pour assurer la cohérence de ces différentes dispositions, qui doivent entrer en vigueur en même temps, et pour donner une vision globale de toutes les informations pertinentes relatives à une titrisation et permettre un accès aisé à celles-ci, il est nécessaire de regrouper ces normes techniques d'exécution dans un règlement unique.

([1]) JO L 347 du 28.12.2017, p. 35.

([2]) Règlement (UE) 2017/1129 du Parlement européen et du Conseil du 14 juin 2017 concernant le prospectus à publier en cas d'offre au public de valeurs mobilières ou en vue de l'admission de valeurs mobilières à la négociation sur un marché réglementé, et abrogeant la directive 2003/71/CE (JO L 168 du 30.6.2017, p. 12).

([3]) 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).

([4]) 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 (JO L 337 du 23.12.2015, p. 1).

(5) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF).

(6) L'AEMF a mené une consultation publique ouverte sur les projets de normes techniques d'exécution sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels connexes et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ([5]),

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

SECTION 1

MODÈLES POUR TOUTES LES TITRISATIONS

Article premier

Modèles pour les expositions sous-jacentes

1. Les informations visées à l'article 2, paragraphes 1 et 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224 de la Commission ([6]) sont mises à disposition au moyen des modèles suivants:

a) le modèle figurant à l'annexe II du présent règlement pour les prêts aux ménages garantis par des biens immobiliers résidentiels, quelle que soit la finalité de ces prêts;

b) le modèle figurant à l'annexe III du présent règlement pour les prêts destinés à l'achat de biens immobiliers commerciaux ou garantis par des biens immobiliers commerciaux;

c) le modèle figurant à l'annexe IV du présent règlement pour les expositions sous-jacentes sur des entreprises, qui comprennent les expositions sous-jacentes sur des micro, petites et moyennes entreprises;

d) le modèle figurant à l'annexe V du présent règlement pour les expositions sous-jacentes automobiles, qui comprennent les prêts et contrats de location à des personnes physiques ou morales adossés à des automobiles;

e) le modèle figurant à l'annexe VI du présent règlement pour les expositions sous-jacentes sur des prêts à la consommation;

f) le modèle figurant à l'annexe VII du présent règlement pour les expositions sous-jacentes sur des cartes de crédit;

g) le modèle figurant à l'annexe VIII du présent règlement pour les expositions sous-jacentes sur des contrats de location;

h) le modèle figurant à l'annexe IX du présent règlement pour les expositions sous-jacentes qui ne relèvent d'aucune des catégories visées aux points a) à g).

2. Les informations visées à l'article 2, paragraphe 3, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen des modèles suivants:

a) les modèles indiqués au paragraphe 1 du présent article, selon le type d'exposition sous-jacente;

b) le modèle figurant à l'annexe X pour les titrisations d'expositions non performantes visées à l'article 2, paragraphe 3, deuxième alinéa, du règlement délégué (UE) 2020/1224.

3. Les informations visées à l'article 2, paragraphe 4, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XI.

([5]) 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).

([6]) Règlement délégué (UE) 2020/1224 de la Commission du 16 octobre 2019 complétant le règlement (UE) 2017/2402 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations et les détails d'une titrisation que l'initiateur, le sponsor et la SSPE doivent mettre à disposition (voir page 1 du présent Journal officiel).

Article 2

Modèles pour les rapports destinés aux investisseurs

1. Les informations visées à l'article 3, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XII.

2. Les informations visées à l'article 3, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XIII.

SECTION 2

MODÈLES POUR LES TITRISATIONS POUR LESQUELLES UN PROSPECTUS DOIT ÊTRE ÉTABLI (TITRISATIONS PUBLIQUES)

Article 3

Modèles pour les informations privilégiées

1. Les informations visées à l'article 6, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XIV.

2. Les informations visées à l'article 6, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XV.

Article 4

Modèles pour les événements importants

1. Les informations visées à l'article 7, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XIV.

2. Les informations visées à l'article 7, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2020/1224 sont mises à disposition au moyen du modèle figurant à l'annexe XV.

SECTION 3

DISPOSITIONS COMMUNES

Article 5

Format des informations

1. Le format des informations fournies dans les modèles figurant aux annexes I à XV est conforme au format correspondant indiqué dans le tableau 1 de l'annexe I.

2. Les informations sont mises à disposition sous une forme électronique lisible par machine au moyen de modèles XML communs.

Article 6

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 29 octobre 2019.

Par la Commission
Le president
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE I

Format des champs

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{ALPHANUM-n}	Jusqu'à n caractères alphanumériques	Texte libre. À saisir en capitales au format ASCII (sans caractères accentués).
{COUNTRYCODE_2}	2 caractères alphanumériques	Code pays à 2 lettres suivant la norme ISO 3166-1 alpha-2. À saisir au format ASCII (sans caractères accentués).
{CURRENCYCODE_3}	3 caractères alphanumériques	Code monnaie à 3 lettres suivant la norme ISO 4217. À saisir au format ASCII (sans caractères accentués).
{YEAR}	Format de date ISO 8601	Indiquer les années selon le format suivant: AAAA
{DATEFORMAT}	Format de date ISO 8601	Indiquer les dates selon le format suivant: AAAA-MM-JJ
{MONETARY}	De 0 à 18 chiffres, dont 5 décimales maximum	Nombre d'unités monétaires exprimées dans une monnaie dont l'unité monétaire est explicite et conforme à la norme ISO 4217.
{NUMERIC}	De 0 à 18 chiffres, dont 5 décimales maximum	Jusqu'à 18 caractères numériques, dont 5 décimales maximum. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal est nécessaire, utiliser le point.
{INTEGER-n}	Nombre entier jusqu'à n	Champ numérique pouvant contenir des entiers positifs ou négatifs.
{Y/N}	1 caractère alphanumérique	«vrai» - Y «faux» - N
{ISIN}	12 caractères alphanumériques	Code ISIN suivant la norme ISO 6166
{LEI}	20 caractères alphanumériques	Identifiant de l'entité juridique suivant la norme ISO 17442
{LIST}		Selon la liste indiquée dans la description du champ concerné
{NUTS}	5 caractères alphanumériques	Selon la nomenclature des unités territoriales statistiques établie par Eurostat. Les informations doivent être fournies au niveau 3 de la NUTS. http://ec.europa.eu/eurostat/web/nuts/
{NACE}	7 caractères alphanumériques	Selon la nomenclature statistique des activités économiques dans l'Union européenne disponible sur le site web ci-dessous et établie par le règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil ([1]). Choisir le niveau de classification le plus détaillé pour chaque activité économique (c'est-à-dire le code complet de 6 ou 7 caractères, décimales incluses). http://ec.europa.eu/competition/mergers/cases/index/nace_all.html

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{PERCENTAGE}	De 0 à 11 chiffres, dont 10 décimales maximum	Taux exprimé en pourcentage, c'est-à-dire en centièmes (par exemple 0,7 est égal à 7/10 de pourcentage et 7,0 est égal à 7 %).
{TELEPHONE}	«+» suivi du code pays (de 1 à 3 caractères) puis d'un «-» (tiret) et d'une combinaison de chiffres, «(», «)», «+» et «-» (jusqu'à 30 caractères).	L'ensemble des informations qui permettent d'identifier un numéro de téléphone particulier, telles que définies par les services de télécommunications.
{ESA}	7 caractères alphanumériques	Indiquer le secteur concerné dans le système européen des comptes (2010), en utilisant les codes du tableau 1 de l'annexe I du règlement délégué (UE) 2020/1224 mis à disposition par l'initiateur, le sponsor et la SSPE [2]. http://ec.europa.eu/eurostat/cache/metadata/Annexes/nasa_10_f_esms_an1.pdf
{WATCHLIST}	2 caractères alphanumériques	Indiquer le code de la liste de surveillance des organes de gestion figurant dans le tableau 2 de l'annexe I du règlement délégué (UE) 2020/1224 mis à disposition par l'initiateur, le sponsor et la SSPE.

[1] Règlement (CE) nº 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) nº 3037/90 du Conseil ainsi que certains règlements (CE) relatifs à des domaines statistiques spécifiques (JO L 393 du 30.12.2006, p. 1).

[2] Règlement délégué (UE) 2020/1224 de la Commission du 16 octobre 2019 complétant le règlement (UE) 2017/2402 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations et les détails d'une titrisation que l'initiateur, le sponsor et la SSPE doivent mettre à disposition (voir page 1 du présent Journal officiel).

ANNEXE II

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Immobilier résidentiel (RRE)

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
RREL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
RREL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
RREL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
RREL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
RREL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
RREL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
RREL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
RREL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
RREL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
RREL10	Résident	{Y/N}
RREL11	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
RREL12	Classification des régions géographiques	{YEAR}
RREL13	Situation professionnelle	{LIST}
RREL14	Débiteur en difficulté	{Y/N}
RREL15	Type de client	{LIST}
RREL16	Revenu principal	{MONETARY}
RREL17	Type de revenu principal	{LIST}
RREL18	Monnaie du revenu principal	{CURRENCYCODE_3}
RREL19	Vérification du revenu principal	{LIST}
RREL20	Revenus secondaires	{MONETARY}
RREL21	Vérification des revenus secondaires	{LIST}
RREL22	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
RREL23	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
RREL24	Date d'échéance	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
RREL25	Durée initiale du prêt	{INTEGER-9999}
RREL26	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
RREL27	Finalité	{LIST}
RREL28	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
RREL29	Encours initial du principal	{MONETARY}
RREL30	Encours actuel du principal	{MONETARY}
RREL31	Soldes de principal de rang supérieur	{MONETARY}
RREL32	Expositions sous-jacentes de rang égal	{MONETARY}
RREL33	Montant limite du crédit	{MONETARY}
RREL34	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
RREL35	Type d'amortissement	{LIST}
RREL36	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
RREL37	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
RREL38	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
RREL39	Prochain paiement dû	{MONETARY}
RREL40	Ratio de la dette au revenu	{PERCENTAGE}
RREL41	Montant libératoire	{MONETARY}
RREL42	Type de taux d'intérêt	{LIST}
RREL43	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
RREL44	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
RREL45	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
RREL46	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
RREL47	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
RREL48	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
RREL49	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
RREL50	Marge à la révision 1	{PERCENTAGE}
RREL51	Date 1 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
RREL52	Marge à la révision 2	{PERCENTAGE}
RREL53	Date 2 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}
RREL54	Marge à la révision 3	{PERCENTAGE}
RREL55	Date 3 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}
RREL56	Indice de référence du taux d'intérêt révisé	{LIST}
RREL57	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt révisé	{LIST}
RREL58	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
RREL59	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
RREL60	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
RREL61	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
RREL62	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
RREL63	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
RREL64	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}
RREL65	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
RREL66	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
RREL67	Encours des arriérés	{MONETARY}
RREL68	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
RREL69	Situation du compte	{LIST}
RREL70	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
RREL71	Montant du défaut	{MONETARY}
RREL72	Date du défaut	{DATEFORMAT}
RREL73	Pertes allouées	{MONETARY}
RREL74	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
RREL75	Contentieux	{Y/N}
RREL76	Recours	{Y/N}
RREL77	Montant des dépôts	{MONETARY}
RREL78	Fournisseur de l'assurance ou de l'investissement	{ALPHANUM-1000}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
RREL79	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
RREL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
RREL81	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
RREL82	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
RREL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
RREL84	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}
Informations au niveau de la sûreté		
RREC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
RREC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
RREC3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
RREC4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
RREC5	Type de sûreté	{LIST}
RREC6	Région géographique — Sûreté	{NUTS}
RREC7	Type d'occupation	{LIST}
RREC8	Privilège	{INTEGER-9999}
RREC9	Type de bien	{LIST}
RREC10	Valeur du certificat de performance énergétique	{LIST}
RREC11	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	{ALPHANUM-100}
RREC12	Ratio actuel prêt/valeur	{PERCENTAGE}
RREC13	Montant de la valorisation actuelle	{MONETARY}
RREC14	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	{LIST}
RREC15	Date de valorisation actuelle	{DATEFORMAT}
RREC16	Ratio initial prêt/valeur	{PERCENTAGE}
RREC17	Montant de la valorisation initiale	{MONETARY}
RREC18	Méthode suivie pour la valorisation initiale	{LIST}
RREC19	Date de la valorisation initiale	{DATEFORMAT}
RREC20	Date de la vente	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
RREC21	Prix de vente	{MONETARY}
RREC22	Monnaie de la sûreté	{CURRENCYCODE_3}
RREC23	Type de garant	{LIST}

ANNEXE III

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Immobilier commercial (CRE)

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
CREL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CREL2	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CREL3	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CREL4	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CREL5	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CREL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
CREL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
CREL8	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
CREL9	Date de rachat	{DATEFORMAT}
CREL10	Date de substitution	{DATEFORMAT}
CREL11	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
CREL12	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
CREL13	Classification des régions géographiques	{YEAR}
CREL14	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
CREL15	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
CREL16	Date de début de l'amortissement	{DATEFORMAT}
CREL17	Date d'échéance du prêt à la date de titrisation	{DATEFORMAT}
CREL18	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
CREL19	Durée initiale du prêt	{INTEGER-9999}
CREL20	Durée de l'option de prolongation	{INTEGER-9999}
CREL21	Nature de l'option de prolongation	{LIST}
CREL22	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
CREL23	Encours actuel du principal	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL24	Encours initial du principal	{MONETARY}
CREL25	Encours initial du principal à la date de titrisation	{MONETARY}
CREL26	Solde non tiré de la facilité engagée pour l'exposition sous-jacente	{MONETARY}
CREL27	Total des autres montants restant à percevoir	{MONETARY}
CREL28	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
CREL29	Date d'utilisation la plus récente	{DATEFORMAT}
CREL30	Finalité	{LIST}
CREL31	Structure	{LIST}
CREL32	Cascade A-B — Versements d'intérêts prévus dans l'échéancier en phase de pré-exécution	{LIST}
CREL33	Cascade A-B — Remboursements du principal prévus dans l'échéancier en phase de pré-exécution	{LIST}
CREL34	Remboursements de principal alloués au prêt de premier rang	{PERCENTAGE}
CREL35	Type de cascade	{LIST}
CREL36	Prix d'achat de l'exposition sous-jacente en cas de défaut	{PERCENTAGE}
CREL37	Possibilité de paiements à des fins de rétablissement?	{LIST}
CREL38	Restrictions concernant la vente du prêt subordonné?	{Y/N}
CREL39	Le détenteur du prêt subordonné est-il affilié au débiteur?	{Y/N}
CREL40	Contrôle exercé par le détenteur du prêt subordonné sur le processus de rééchelonnement	{Y/N}
CREL41	Y a-t-il défaut sur l'exposition sous-jacente en cas de non-paiement sur les créances prioritaires?	{Y/N}
CREL42	Y a-t-il défaut sur le bien en cas de non-paiement sur les expositions sous-jacentes de même rang?	{Y/N}
CREL43	Consentement du porteur de titres	{Y/N}
CREL44	Réunion prévue des porteurs de titres	{DATEFORMAT}
CREL45	Syndication	{Y/N}
CREL46	Participation de la SSPE	{LIST}
CREL47	Conséquence en cas de rupture de convention	{LIST}
CREL48	Pénalités pour non présentation des informations financières	{Y/N}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL49	Recours	{Y/N}
CREL50	Recours — 3e partie	{Y/N}
CREL51	Norme de recouvrement	{Y/N}
CREL52	Total des comptes bloqués	{MONETARY}
CREL53	Encaissement des fonds de garantie bloqués	{Y/N}
CREL54	Encaissement d'autres réserves	{Y/N}
CREL55	Événement déclencheur de la constitution de garantie	{LIST}
CREL56	Montants/réserves de garantie cibles	{MONETARY}
CREL57	Conditions de mainlevée du compte de garantie	{ALPHANUM-1000}
CREL58	Conditions de prélèvement sur la réserve de trésorerie	{LIST}
CREL59	Devise du compte de garantie	{CURRENCYCODE_3}
CREL60	Monnaie des versements de garantie	{CURRENCYCODE_3}
CREL61	Solde total des réserves	{MONETARY}
CREL62	Devise des réserves	{CURRENCYCODE_3}
CREL63	Constitution du fonds de garantie consécutive à un événement déclencheur	{Y/N}
CREL64	Montants ajoutés aux fonds de garantie pendant la période courante	{MONETARY}
CREL65	Revenus	{MONETARY}
CREL66	Charges d'exploitation à la date de titrisation	{MONETARY}
CREL67	Dépenses d'investissement à la date de titrisation	{MONETARY}
CREL68	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}
CREL69	Manquement du débiteur à son obligation d'information	{Y/N}
CREL70	Méthode de calcul du ratio de couverture des charges d'emprunt	{LIST}
CREL71	Indicateur du ratio de couverture des charges d'emprunt à la date de titrisation	{LIST}
CREL72	Indicateur le plus récent du ratio de couverture des charges d'emprunt	{LIST}
CREL73	Ratio de couverture des charges d'emprunt à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREL74	Ratio actuel de couverture des charges d'emprunt	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL75	Ratio initial prêt/valeur	{PERCENTAGE}
CREL76	Ratio actuel prêt/valeur	{PERCENTAGE}
CREL77	Ratio de couverture des intérêts à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREL78	Ratio actuel de couverture des intérêts	{PERCENTAGE}
CREL79	Méthode de calcul du ratio de couverture des intérêts	{LIST}
CREL80	Nombre de biens à la date de titrisation	{INTEGER-9999}
CREL81	Nombre de biens à la date d'arrêté des données	{INTEGER-9999}
CREL82	Biens constituant la sûreté de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CREL83	Valorisation du portefeuille de biens à la date de titrisation	{MONETARY}
CREL84	Monnaie dans laquelle est exprimée la valeur du portefeuille de biens à la date de titrisation	{CURRENCYCODE_3}
CREL85	Statut des biens	{LIST}
CREL86	Date d'établissement de la valorisation à la date de titrisation	{DATEFORMAT}
CREL87	Type d'amortissement	{LIST}
CREL88	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
CREL89	Période de grâce autorisée	{INTEGER-9999}
CREL90	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
CREL91	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
CREL92	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
CREL93	Description des conditions de remboursement anticipé	{ALPHANUM-100}
CREL94	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CREL95	Date de fin de l'indemnité actuarielle	{DATEFORMAT}
CREL96	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
CREL97	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CREL98	Encaissements de principal non prévus à l'échéancier	{MONETARY}
CREL99	Date de liquidation/remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CREL100	Code de liquidation/remboursement anticipé	{LIST}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL101	Trop-perçu/moins-perçu sur les intérêts lié à un remboursement anticipé	{MONETARY}
CREL102	Date de paiement	{DATEFORMAT}
CREL103	Prochaine date d'ajustement des versements	{DATEFORMAT}
CREL104	Date du prochain versement	{DATEFORMAT}
CREL105	Prochain paiement dû	{MONETARY}
CREL106	Taux d'intérêt initial	{PERCENTAGE}
CREL107	Taux d'intérêt à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREL108	Première date d'ajustement des versements	{DATEFORMAT}
CREL109	Type de taux d'intérêt	{LIST}
CREL110	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
CREL111	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CREL112	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CREL113	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
CREL114	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
CREL115	Valeur actuelle de l'indice	{PERCENTAGE}
CREL116	Date de détermination de l'indice	{DATEFORMAT}
CREL117	Incrément d'arrondi	{PERCENTAGE}
CREL118	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CREL119	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CREL120	Taux actuel des intérêts pour défaut	{PERCENTAGE}
CREL121	Cumul des intérêts autorisé	{Y/N}
CREL122	Convention de calcul des jours	{LIST}
CREL123	Total du principal et des intérêts dus conformément à l'échéancier	{MONETARY}
CREL124	Total du principal et des intérêts versés conformément à l'échéancier	{MONETARY}
CREL125	Amortissement négatif	{MONETARY}
CREL126	Intérêts différés	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL127	Encours total des moins-perçus enregistrés sur le principal et les intérêts	{MONETARY}
CREL128	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
CREL129	Encours des arriérés	{MONETARY}
CREL130	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
CREL131	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
CREL132	Montant du défaut	{MONETARY}
CREL133	Date du défaut	{DATEFORMAT}
CREL134	Arriérés d'intérêt	{Y/N}
CREL135	Intérêts réels versés pour défaut de paiement	{MONETARY}
CREL136	Situation du compte	{LIST}
CREL137	Pertes allouées	{MONETARY}
CREL138	Produits nets reçus de la liquidation	{MONETARY}
CREL139	Frais de liquidation	{MONETARY}
CREL140	Calendrier attendu des recouvrements	{INTEGER-9999}
CREL141	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
CREL142	Date de début de la phase d'exécution	{DATEFORMAT}
CREL143	Code de la stratégie de restructuration	{LIST}
CREL144	Modification	{LIST}
CREL145	Statut en matière de recouvrement spécial	{Y/N}
CREL146	Date la plus récente de cession à un organe de gestion spécial	{DATEFORMAT}
CREL147	Date de dernier retour à l'organe de gestion principal	{DATEFORMAT}
CREL148	Détermination de l'impossibilité de recouvrer les fonds	{Y/N}
CREL149	Élément déclencheur/violation de la convention	{LIST}
CREL150	Date de violation	{DATEFORMAT}
CREL151	Date à laquelle la violation a cessé	{DATEFORMAT}
CREL152	Code de la liste de surveillance de l'organe de gestion	{WATCHLIST}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL153	Date d'inscription sur la liste de surveillance de l'organe de gestion	{DATEFORMAT}
CREL154	Fournisseur du swap de taux d'intérêt	{ALPHANUM-1000}
CREL155	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de taux d'intérêt	{LEI}
CREL156	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	{DATEFORMAT}
CREL157	Notionnel du swap de taux d'intérêt	{MONETARY}
CREL158	Fournisseur du swap de devises	{ALPHANUM-1000}
CREL159	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de devises	{LEI}
CREL160	Date d'échéance du swap de devises	{DATEFORMAT}
CREL161	Notionnel du swap de devises	{MONETARY}
CREL162	Taux de change pour swap de devises	{PERCENTAGE}
CREL163	Fournisseur d'un autre type de swap	{ALPHANUM-1000}
CREL164	Identifiant d'entité juridique du fournisseur d'un autre type de swap	{LEI}
CREL165	Frais de résiliation du swap dus par le débiteur	{LIST}
CREL166	Événement à l'origine de l'annulation totale ou partielle du swap durant la période en cours	{LIST}
CREL167	Montant net des versements réguliers effectués par le fournisseur du swap	{MONETARY}
CREL168	Frais de résiliation du swap dus au fournisseur du swap sur l'exposition sous-jacente	{MONETARY}
CREL169	Moins-perçu sur le paiement des frais de résiliation du swap	{MONETARY}
CREL170	Frais de résiliation dus par la contrepartie du swap	{MONETARY}
CREL171	Prochaine date de révision du swap	{DATEFORMAT}
CREL172	Sponsor	{ALPHANUM-100}
CREL173	Identifiant d'entité juridique de la banque chef de file de la syndication	{LEI}
CREL174	Identifiant d'entité juridique de l'organe de gestion	{LEI}
CREL175	Nom de l'organe de gestion	{ALPHANUM-100}
CREL176	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
CREL177	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
CREL178	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREL179	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
CREL180	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
CREL181	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
Informations au niveau de la sûreté		
CREC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CREC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CREC3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
CREC4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
CREC5	Type de sûreté	{LIST}
CREC6	Nom du bien	{ALPHANUM-100}
CREC7	Adresse du bien	{ALPHANUM-1000}
CREC8	Région géographique — Sûreté	{NUTS}
CREC9	Code postal du bien	{ALPHANUM-100}
CREC10	Privilège	{INTEGER-9999}
CREC11	Statut du bien	{LIST}
CREC12	Type de bien	{LIST}
CREC13	Forme du titre de propriété du bien	{LIST}
CREC14	Date de valorisation actuelle	{DATEFORMAT}
CREC15	Montant de la valorisation actuelle	{MONETARY}
CREC16	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	{LIST}
CREC17	Date de valorisation actuelle	{LIST}
CREC18	Méthode suivie pour la valorisation initiale	{LIST}
CREC19	Date de titrisation de la sûreté	{DATEFORMAT}
CREC20	Pourcentage de l'exposition sous-jacente alloué à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREC21	Pourcentage de l'exposition sous-jacente actuellement alloué	{PERCENTAGE}
CREC22	Valorisation à la date de titrisation	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREC23	Nom de l'entité chargée de la valorisation à la date de titrisation	{ALPHANUM-100}
CREC24	Date de préparation de la valorisation à la date de titrisation	{DATEFORMAT}
CREC25	Année de construction	{YEAR}
CREC26	Dernière année de rénovation	{YEAR}
CREC27	Nombre d'unités	{INTEGER-999999999}
CREC28	Mètres carrés nets	{INTEGER-999999999}
CREC29	Surface commerciale	{INTEGER-999999999}
CREC30	Surface résidentielle	{INTEGER-999999999}
CREC31	Surface utile nette contrôlée	{Y/N}
CREC32	Occupation à la dernière date pertinente	{DATEFORMAT}
CREC33	Taux d'occupation économique à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREC34	Taux d'occupation physique à la date de titrisation	{PERCENTAGE}
CREC35	Valeur du bien vacant à la date de titrisation	{MONETARY}
CREC36	Date des données financières utilisées à la date de titrisation	{DATEFORMAT}
CREC37	Recettes nettes d'exploitation à la date de titrisation	{MONETARY}
CREC38	Date de début de la période couverte par les informations financières les plus récentes	{DATEFORMAT}
CREC39	Date de fin de la période couverte par les informations financières les plus récentes	{DATEFORMAT}
CREC40	Revenu le plus récent	{MONETARY}
CREC41	Dépenses d'exploitation les plus récentes	{MONETARY}
CREC42	Dépenses d'investissement les plus récentes	{MONETARY}
CREC43	Loyer foncier	{MONETARY}
CREC44	Durée moyenne pondérée des baux	{INTEGER-9999}
CREC45	Expiration du contrat de location	{DATEFORMAT}
CREC46	Revenu locatif contractuel annuel	{MONETARY}
CREC47	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 1 à 12 mois	{PERCENTAGE}
CREC48	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 13 à 24 mois	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CREC49	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 25 à 36 mois	{PERCENTAGE}
CREC50	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 37 à 48 mois	{PERCENTAGE}
CREC51	Pourcentage des revenus qui arriveront à expiration dans 49 mois ou plus	{PERCENTAGE}

Informations au niveau du locataire

CRET1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CRET2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CRET3	Identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
CRET4	Identifiant du locataire	{ALPHANUM-1000}
CRET5	Nom du locataire	{ALPHANUM-100}
CRET6	Code NACE de l'activité	{NACE}
CRET7	Date d'expiration du contrat de location	{DATEFORMAT}
CRET8	Loyer demandé	{MONETARY}
CRET9	Monnaie du loyer	{CURRENCYCODE_3}

ANNEXE IV

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Entreprises

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
CRPL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CRPL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CRPL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CRPL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CRPL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CRPL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
CRPL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
CRPL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
CRPL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
CRPL10	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
CRPL11	Classification des régions géographiques	{YEAR}
CRPL12	Débiteur en difficulté	{Y/N}
CRPL13	Type de client	{LIST}
CRPL14	Code NACE de l'activité	{NACE}
CRPL15	Segment du débiteur selon Bâle III	{LIST}
CRPL16	Taille de l'entreprise	{LIST}
CRPL17	Chiffre d'affaires	{MONETARY}
CRPL18	Total des dettes	{MONETARY}
CRPL19	EBITDA	{MONETARY}
CRPL20	Valeur de l'entreprise	{MONETARY}
CRPL21	Flux de trésorerie disponible	{MONETARY}
CRPL22	Date des données financières	{DATEFORMAT}
CRPL23	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CRPL24	Type de créance	{LIST}
CRPL25	Éléments titrisés	{LIST}
CRPL26	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	{ISIN}
CRPL27	Rang	{LIST}
CRPL28	Syndication	{Y/N}
CRPL29	Opération à effet de levier	{Y/N}
CRPL30	Gestion par CLO	{Y/N}
CRPL31	Paiement en nature	{Y/N}
CRPL32	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
CRPL33	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
CRPL34	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
CRPL35	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
CRPL36	Finalité	{LIST}
CRPL37	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
CRPL38	Encours initial du principal	{MONETARY}
CRPL39	Encours actuel du principal	{MONETARY}
CRPL40	Soldes de principal de rang supérieur	{MONETARY}
CRPL41	Valeur de marché	{MONETARY}
CRPL42	Montant limite du crédit	{MONETARY}
CRPL43	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
CRPL44	Date d'exercice de l'option de vente	{DATEFORMAT}
CRPL45	Prix d'exercice de l'option de vente	{MONETARY}
CRPL46	Type d'amortissement	{LIST}
CRPL47	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
CRPL48	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
CRPL49	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CRPL50	Prochain paiement dû	{MONETARY}
CRPL51	Montant libératoire	{MONETARY}
CRPL52	Type de taux d'intérêt	{LIST}
CRPL53	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
CRPL54	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CRPL55	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CRPL56	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
CRPL57	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
CRPL58	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CRPL59	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CRPL60	Marge à la révision 1	{PERCENTAGE}
CRPL61	Date 1 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}
CRPL62	Marge à la révision 2	{PERCENTAGE}
CRPL63	Date 2 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}
CRPL64	Marge à la révision 3	{PERCENTAGE}
CRPL65	Date 3 de révision des intérêts	{DATEFORMAT}
CRPL66	Indice de référence du taux d'intérêt révisé	{LIST}
CRPL67	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt révisé	{LIST}
CRPL68	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
CRPL69	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
CRPL70	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CRPL71	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
CRPL72	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CRPL73	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CRPL74	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}
CRPL75	Date de restructuration	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CRPL76	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
CRPL77	Encours des arriérés	{MONETARY}
CRPL78	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
CRPL79	Situation du compte	{LIST}
CRPL80	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
CRPL81	Montant du défaut	{MONETARY}
CRPL82	Date du défaut	{DATEFORMAT}
CRPL83	Pertes allouées	{MONETARY}
CRPL84	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
CRPL85	Sources de recouvrement	{LIST}
CRPL86	Recours	{Y/N}
CRPL87	Montant des dépôts	{MONETARY}
CRPL88	Notionnel du swap de taux d'intérêt	{MONETARY}
CRPL89	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de taux d'intérêt	{LEI}
CRPL90	Fournisseur du swap de taux d'intérêt	{ALPHANUM-1000}
CRPL91	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	{DATEFORMAT}
CRPL92	Notionnel du swap de devises	{MONETARY}
CRPL93	Identifiant d'entité juridique du fournisseur du swap de devises	{LEI}
CRPL94	Fournisseur du swap de devises	{ALPHANUM-1000}
CRPL95	Date d'échéance du swap de devises	{DATEFORMAT}
CRPL96	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
CRPL97	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
CRPL98	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
CRPL99	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
CRPL100	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
CRPL101	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations au niveau de la sûreté		
CRPC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CRPC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CRPC3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
CRPC4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
CRPC5	Région géographique — Sûreté	{NUTS}
CRPC6	Type de sûreté	{LIST}
CRPC7	Type de charge	{LIST}
CRPC8	Privilège	{INTEGER-9999}
CRPC9	Type de sûreté	{LIST}
CRPC10	Montant de la valorisation actuelle	{MONETARY}
CRPC11	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	{LIST}
CRPC12	Date de valorisation actuelle	{DATEFORMAT}
CRPC13	Montant de la valorisation initiale	{MONETARY}
CRPC14	Méthode suivie pour la valorisation initiale	{LIST}
CRPC15	Date de la valorisation initiale	{DATEFORMAT}
CRPC16	Date de la vente	{DATEFORMAT}
CRPC17	Prix de vente	{MONETARY}
CRPC18	Monnaie de la sûreté	{CURRENCYCODE_3}
CRPC19	Pays du garant	{COUNTRYCODE_2}
CRPC20	Sous-secteur SEC du garant	{ESA}

ANNEXE V

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Automobiles

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
AUTL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
AUTL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
AUTL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
AUTL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
AUTL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
AUTL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
AUTL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
AUTL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
AUTL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
AUTL10	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
AUTL11	Classification des régions géographiques	{YEAR}
AUTL12	Situation professionnelle	{LIST}
AUTL13	Débiteur en difficulté	{Y/N}
AUTL14	Forme juridique du débiteur	{LIST}
AUTL15	Type de client	{LIST}
AUTL16	Revenu principal	{MONETARY}
AUTL17	Type de revenu principal	{LIST}
AUTL18	Monnaie du revenu principal	{CURRENCYCODE_3}
AUTL19	Vérification du revenu principal	{LIST}
AUTL20	Chiffre d'affaires	{MONETARY}
AUTL21	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}
AUTL22	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
AUTL23	Type de produit	{LIST}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
AUTL24	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
AUTL25	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
AUTL26	Durée initiale du prêt	{INTEGER-9999}
AUTL27	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
AUTL28	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
AUTL29	Encours initial du principal	{MONETARY}
AUTL30	Encours actuel du principal	{MONETARY}
AUTL31	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
AUTL32	Type d'amortissement	{LIST}
AUTL33	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
AUTL34	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
AUTL35	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
AUTL36	Mode de remboursement	{LIST}
AUTL37	Prochain paiement dû	{MONETARY}
AUTL38	Montant libératoire	{MONETARY}
AUTL39	Montant de l'apport initial	{MONETARY}
AUTL40	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
AUTL41	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
AUTL42	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
AUTL43	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
AUTL44	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
AUTL45	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
AUTL46	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
AUTL47	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
AUTL48	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
AUTL49	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
AUTL50	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
AUTL51	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
AUTL52	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}
AUTL53	Fabricant	{ALPHANUM-100}
AUTL54	Modèle	{ALPHANUM-100}
AUTL55	Année d'immatriculation	{YEAR}
AUTL56	De première main ou d'occasion	{LIST}
AUTL57	Valeur du certificat de performance énergétique	{LIST}
AUTL58	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	{ALPHANUM-100}
AUTL59	Ratio initial prêt/valeur	{PERCENTAGE}
AUTL60	Montant de la valorisation initiale	{MONETARY}
AUTL61	Valeur résiduelle initiale du véhicule	{MONETARY}
AUTL62	Prix à l'exercice de l'option d'achat	{MONETARY}
AUTL63	Valeur résiduelle titrisée	{MONETARY}
AUTL64	Valeur résiduelle actualisée du véhicule	{MONETARY}
AUTL65	Date d'actualisation de la valeur résiduelle du véhicule	{DATEFORMAT}
AUTL66	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
AUTL67	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
AUTL68	Encours des arriérés	{MONETARY}
AUTL69	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
AUTL70	Situation du compte	{LIST}
AUTL71	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
AUTL72	Montant du défaut	{MONETARY}
AUTL73	Date du défaut	{DATEFORMAT}
AUTL74	Pertes allouées	{MONETARY}
AUTL75	Pertes sur la valeur résiduelle	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
AUTL76	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
AUTL77	Prix de vente	{MONETARY}
AUTL78	Montant des dépôts	{MONETARY}
AUTL79	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
AUTL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
AUTL81	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
AUTL82	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
AUTL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
AUTL84	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}

ANNEXE VI

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Crédits à la consommation

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
CMRL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CMRL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CMRL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CMRL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CMRL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CMRL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
CMRL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
CMRL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
CMRL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
CMRL10	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
CMRL11	Classification des régions géographiques	{YEAR}
CMRL12	Situation professionnelle	{LIST}
CMRL13	Débiteur en difficulté	{Y/N}
CMRL14	Type de client	{LIST}
CMRL15	Revenu principal	{MONETARY}
CMRL16	Type de revenu principal	{LIST}
CMRL17	Monnaie du revenu principal	{CURRENCYCODE_3}
CMRL18	Vérification du revenu principal	{LIST}
CMRL19	Garanti par un salaire/une pension	{Y/N}
CMRL20	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
CMRL21	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
CMRL22	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
CMRL23	Durée initiale du prêt	{INTEGER-9999}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CMRL24	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
CMRL25	Finalité	{LIST}
CMRL26	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
CMRL27	Encours initial du principal	{MONETARY}
CMRL28	Encours actuel du principal	{MONETARY}
CMRL29	Montant limite du crédit	{MONETARY}
CMRL30	Date de fin de la période de renouvellement	{DATEFORMAT}
CMRL31	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
CMRL32	Type d'amortissement	{LIST}
CMRL33	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
CMRL34	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
CMRL35	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
CMRL36	Prochain paiement dû	{MONETARY}
CMRL37	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
CMRL38	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CMRL39	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CMRL40	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
CMRL41	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
CMRL42	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CMRL43	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
CMRL44	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
CMRL45	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
CMRL46	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CMRL47	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
CMRL48	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
CMRL49	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CMRL50	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}
CMRL51	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
CMRL52	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
CMRL53	Encours des arriérés	{MONETARY}
CMRL54	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
CMRL55	Situation du compte	{LIST}
CMRL56	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
CMRL57	Montant du défaut	{MONETARY}
CMRL58	Date du défaut	{DATEFORMAT}
CMRL59	Pertes allouées	{MONETARY}
CMRL60	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
CMRL61	Montant des dépôts	{MONETARY}
CMRL62	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
CMRL63	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
CMRL64	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
CMRL65	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
CMRL66	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
CMRL67	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}
CMRL68	Valeur du certificat de performance énergétique	{LIST}
CMRL69	Nom du fournisseur du certificat de performance énergétique	{ALPHANUM-100}

ANNEXE VII

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Cartes de crédit

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
CCDL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
CCDL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CCDL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
CCDL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CCDL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
CCDL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
CCDL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
CCDL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
CCDL9	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
CCDL10	Classification des régions géographiques	{YEAR}
CCDL11	Situation professionnelle	{LIST}
CCDL12	Débiteur en difficulté	{Y/N}
CCDL13	Type de client	{LIST}
CCDL14	Revenu principal	{MONETARY}
CCDL15	Type de revenu principal	{LIST}
CCDL16	Monnaie du revenu principal	{CURRENCYCODE_3}
CCDL17	Vérification du revenu principal	{LIST}
CCDL18	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
CCDL19	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
CCDL20	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
CCDL21	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
CCDL22	Encours actuel du principal	{MONETARY}
CCDL23	Montant limite du crédit	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
CCDL24	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
CCDL25	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
CCDL26	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
CCDL27	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
CCDL28	Prochain paiement dû	{MONETARY}
CCDL29	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
CCDL30	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CCDL31	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
CCDL32	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
CCDL33	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
CCDL34	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
CCDL35	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
CCDL36	Encours des arriérés	{MONETARY}
CCDL37	Situation du compte	{LIST}
CCDL38	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
CCDL39	Montant du défaut	{MONETARY}
CCDL40	Date du défaut	{DATEFORMAT}
CCDL41	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
CCDL42	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
CCDL43	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
CCDL44	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
CCDL45	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
CCDL46	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
CCDL47	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}

ANNEXE VIII

MODÈLE POUR LES EXPOSITIONS SOUS-JACENTES — CONTRATS DE LOCATION

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
LESL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
LESL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
LESL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
LESL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
LESL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
LESL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
LESL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
LESL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
LESL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
LESL10	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
LESL11	Classification des régions géographiques	{YEAR}
LESL12	Débiteur en difficulté	{Y/N}
LESL13	Segment du débiteur selon Bâle III	{LIST}
LESL14	Type de client	{LIST}
LESL15	Code NACE de l'activité	{NACE}
LESL16	Taille de l'entreprise	{LIST}
LESL17	Chiffre d'affaires	{MONETARY}
LESL18	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}
LESL19	Type de produit	{LIST}
LESL20	Syndication	{Y/N}
LESL21	Dispositif particulier	{ALPHANUM-10000}
LESL22	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
LESL23	Date d'échéance	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
LESL24	Durée initiale du prêt	{INTEGER-9999}
LESL25	Canal à l'origine de l'initiation	{LIST}
LESL26	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
LESL27	Encours initial du principal	{MONETARY}
LESL28	Encours actuel du principal	{MONETARY}
LESL29	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
LESL30	Valeur résiduelle titrisée	{MONETARY}
LESL31	Type d'amortissement	{LIST}
LESL32	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
LESL33	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
LESL34	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
LESL35	Prochain paiement dû	{MONETARY}
LESL36	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
LESL37	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
LESL38	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
LESL39	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
LESL40	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
LESL41	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
LESL42	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
LESL43	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
LESL44	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
LESL45	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
LESL46	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
LESL47	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
LESL48	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
LESL49	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
LESL50	Prix à l'exercice de l'option d'achat	{MONETARY}
LESL51	Montant de l'apport initial	{MONETARY}
LESL52	Valeur résiduelle actuelle de l'actif	{MONETARY}
LESL53	Date de restructuration	{DATEFORMAT}
LESL54	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
LESL55	Encours des arriérés	{MONETARY}
LESL56	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
LESL57	Situation du compte	{LIST}
LESL58	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
LESL59	Montant du défaut	{MONETARY}
LESL60	Date du défaut	{DATEFORMAT}
LESL61	Pertes allouées	{MONETARY}
LESL62	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
LESL63	Sources de recouvrement	{LIST}
LESL64	Montant des dépôts	{MONETARY}
LESL65	Région géographique — Sûreté	{NUTS}
LESL66	Fabricant	{ALPHANUM-100}
LESL67	Modèle	{ALPHANUM-100}
LESL68	Année de fabrication/construction	{YEAR}
LESL69	De première main ou d'occasion	{LIST}
LESL70	Valeur résiduelle initiale de l'actif	{MONETARY}
LESL71	Type de sûreté	{LIST}
LESL72	Montant de la valorisation initiale	{MONETARY}
LESL73	Méthode suivie pour la valorisation initiale	{LIST}
LESL74	Date de la valorisation initiale	{DATEFORMAT}
LESL75	Montant de la valorisation actuelle	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
LESL76	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	{LIST}
LESL77	Date de valorisation actuelle	{DATEFORMAT}
LESL78	Nombre d'objets loués	{INTEGER-9999}
LESL79	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
LESL80	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
LESL81	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}
LESL82	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
LESL83	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
LESL84	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}

ANNEXE IX

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Montages ésotériques

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
ESTL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
ESTL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
ESTL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
ESTL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
ESTL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
ESTL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
ESTL7	Date de l'ajout au panier	{DATEFORMAT}
ESTL8	Date de rachat	{DATEFORMAT}
ESTL9	Date de remboursement	{DATEFORMAT}
ESTL10	Description	{ALPHANUM-1000}
ESTL11	Région géographique — Débiteur	{NUTS}
ESTL12	Classification des régions géographiques	{YEAR}
ESTL13	Situation professionnelle	{LIST}
ESTL14	Débiteur en difficulté	{Y/N}
ESTL15	Forme juridique du débiteur	{LIST}
ESTL16	Code NACE de l'activité	{NACE}
ESTL17	Revenu principal	{MONETARY}
ESTL18	Type de revenu principal	{LIST}
ESTL19	Monnaie du revenu principal	{CURRENCYCODE_3}
ESTL20	Vérification du revenu principal	{LIST}
ESTL21	Chiffre d'affaires	{MONETARY}
ESTL22	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}
ESTL23	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	{ISIN}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
ESTL24	Date d'initiation	{DATEFORMAT}
ESTL25	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
ESTL26	Monnaie de libellé	{CURRENCYCODE_3}
ESTL27	Encours initial du principal	{MONETARY}
ESTL28	Encours actuel du principal	{MONETARY}
ESTL29	Montant limite du crédit	{MONETARY}
ESTL30	Prix d'achat	{PERCENTAGE}
ESTL31	Type d'amortissement	{LIST}
ESTL32	Date de fin de la période de grâce pour le remboursement du principal	{DATEFORMAT}
ESTL33	Périodicité prévue pour le remboursement du principal	{LIST}
ESTL34	Périodicité prévue pour le versement des intérêts	{LIST}
ESTL35	Prochain paiement dû	{MONETARY}
ESTL36	Ratio de la dette au revenu	{PERCENTAGE}
ESTL37	Montant libératoire	{MONETARY}
ESTL38	Intervalle fixé pour la révision du taux d'intérêt	{INTEGER-9999}
ESTL39	Taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
ESTL40	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
ESTL41	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
ESTL42	Marge de taux d'intérêt actuelle	{PERCENTAGE}
ESTL43	Valeur plafond du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
ESTL44	Valeur plancher du taux d'intérêt	{PERCENTAGE}
ESTL45	Nombre de paiements effectués avant la titrisation	{INTEGER-9999}
ESTL46	Pourcentage de remboursement anticipé autorisé chaque année	{PERCENTAGE}
ESTL47	Date de fin d'interdiction de remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
ESTL48	Frais de remboursement anticipé	{MONETARY}
ESTL49	Date de fin de la perception de frais pour remboursement anticipé	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
ESTL50	Date du dernier remboursement anticipé	{DATEFORMAT}
ESTL51	Remboursements anticipés cumulés	{MONETARY}
ESTL52	Date du dernier arriéré	{DATEFORMAT}
ESTL53	Encours des arriérés	{MONETARY}
ESTL54	Nombre de jours d'arriérés	{INTEGER-9999}
ESTL55	Situation du compte	{LIST}
ESTL56	Raison du défaut ou de la saisie	{LIST}
ESTL57	Montant du défaut	{MONETARY}
ESTL58	Date du défaut	{DATEFORMAT}
ESTL59	Pertes allouées	{MONETARY}
ESTL60	Recouvrements cumulés	{MONETARY}
ESTL61	Nom de l'initiateur	{ALPHANUM-100}
ESTL62	Identifiant d'entité juridique de l'initiateur	{LEI}
ESTL63	Pays d'établissement de l'initiateur	{COUNTRYCODE_2}
ESTL64	Nom du prêteur initial	{ALPHANUM-100}
ESTL65	Identifiant d'entité juridique du prêteur initial	{LEI}
ESTL66	Pays d'établissement du prêteur initial	{COUNTRYCODE_2}

Informations au niveau de la sûreté

ESTC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
ESTC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
ESTC3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
ESTC4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
ESTC5	Région géographique — Sûreté	{NUTS}
ESTC6	Type de sûreté	{LIST}
ESTC7	Type de charge	{LIST}
ESTC8	Privilège	{INTEGER-9999}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
ESTC9	Type de sûreté	{LIST}
ESTC10	Montant de la valorisation actuelle	{MONETARY}
ESTC11	Méthode de calcul de la valorisation actuelle	{LIST}
ESTC12	Date de valorisation actuelle	{DATEFORMAT}
ESTC13	Ratio actuel prêt/valeur	{PERCENTAGE}
ESTC14	Montant de la valorisation initiale	{MONETARY}
ESTC15	Méthode suivie pour la valorisation initiale	{LIST}
ESTC16	Date de la valorisation initiale	{DATEFORMAT}
ESTC17	Ratio initial prêt/valeur	{PERCENTAGE}
ESTC18	Date de la vente	{DATEFORMAT}
ESTC19	Prix de vente	{MONETARY}
ESTC20	Monnaie de la sûreté	{CURRENCYCODE_3}

ANNEXE X

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Complément relatif aux expositions non performantes

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
NPEL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
NPEL2	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
NPEL3	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
NPEL4	Identifiant initial du débiteur	{ALPHANUM-1000}
NPEL5	Nouvel identifiant du débiteur	{ALPHANUM-1000}
NPEL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
NPEL7	Sous administration judiciaire	{Y/N}
NPEL8	Date du dernier contact	{DATEFORMAT}
NPEL9	Décédé	{Y/N}
NPEL10	Statut juridique	{LIST}
NPEL11	Type de procédure judiciaire	{LIST}
NPEL12	Nom de la procédure judiciaire	{ALPHANUM-1000}
NPEL13	Mesures légales déjà prises	{ALPHANUM-1000}
NPEL14	Date d'ouverture de la procédure juridique en cours	{DATEFORMAT}
NPEL15	Date de nomination de l'administrateur de l'insolvabilité	{DATEFORMAT}
NPEL16	Nombre de jugements en attente d'exécution	{INTEGER-9999}
NPEL17	Nombre de jugements exécutés	{INTEGER-9999}
NPEL18	Date d'envoi d'une demande de paiement par un tiers	{DATEFORMAT}
NPEL19	Date d'envoi de la lettre de réserve de droits	{DATEFORMAT}
NPEL20	Juridiction saisie	{COUNTRYCODE_2}
NPEL21	Date d'obtention de l'ordonnance d'expulsion	{DATEFORMAT}
NPEL22	Commentaires sur d'éventuelles autres procédures judiciaires	{ALPHANUM-1000}
NPEL23	Droit applicable	{COUNTRYCODE_2}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
NPEL24	Description des modalités spécifiques de remboursement	{ALPHANUM-1000}
NPEL25	Date de début de la période de versement des seuls intérêts	{DATEFORMAT}
NPEL26	Date de fin de la période de versement des seuls intérêts	{DATEFORMAT}
NPEL27	Date de début de la période actuelle d'intérêts fixes	{DATEFORMAT}
NPEL28	Date de fin de la période actuelle d'intérêts fixes	{DATEFORMAT}
NPEL29	Niveau actuel du taux d'intérêt révisable	{PERCENTAGE}
NPEL30	Date de paiement la plus récente	{DATEFORMAT}
NPEL31	Portion syndiquée	{PERCENTAGE}
NPEL32	Déclencement de la procédure MARP	{DATEFORMAT}
NPEL33	Statut MARP	{LIST}
NPEL34	Niveau des encaissements externes	{Y/N}
NPEL35	Plan de remboursement	{Y/N}
NPEL36	Niveau de renégociation	{Y/N}
NPEL37	Date de la première renégociation	{DATEFORMAT}
NPEL38	Nombre de renégociations antérieures	{INTEGER-9999}
NPEL39	Annulation du principal	{MONETARY}
NPEL40	Date d'annulation du principal	{DATEFORMAT}
NPEL41	Date de fin de validité de la renégociation	{DATEFORMAT}
NPEL42	Montant des remboursements après renégociation	{MONETARY}

Informations au niveau de la sûreté

NPEC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
NPEC2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
NPEC3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
NPEC4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
NPEC5	TVA due	{PERCENTAGE}
NPEC6	Pourcentage atteint	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
NPEC7	Statut de la procédure d'exécution	{Y/N}
NPEC8	Statut de la procédure d'exécution du point de vue de tiers	{Y/N}
NPEC9	Montant d'hypothèque attribué	{MONETARY}
NPEC10	Expositions sous-jacentes de rang supérieur	{MONETARY}
NPEC11	Description des modalités d'exécution	{ALPHANUM-1000}
NPEC12	Montant de l'évaluation judiciaire	{MONETARY}
NPEC13	Date de l'évaluation judiciaire	{DATEFORMAT}
NPEC14	Prix sur le marché	{MONETARY}
NPEC15	Offre de prix	{MONETARY}
NPEC16	Date de la préparation du bien pour la vente	{DATEFORMAT}
NPEC17	Date de mise sur le marché	{DATEFORMAT}
NPEC18	Date de l'offre sur le marché	{DATEFORMAT}
NPEC19	Date fixée pour la vente	{DATEFORMAT}
NPEC20	Date du contrat	{DATEFORMAT}
NPEC21	Date de la première mise aux enchères	{DATEFORMAT}
NPEC22	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la première mise aux enchères	{MONETARY}
NPEC23	Date de la mise aux enchères suivante	{DATEFORMAT}
NPEC24	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la mise aux enchères suivante	{MONETARY}
NPEC25	Date de la dernière mise aux enchères	{DATEFORMAT}
NPEC26	Prix de réserve fixé par le tribunal pour la dernière mise aux enchères	{MONETARY}
NPEC27	Nombre de mises aux enchères infructueuses	{INTEGER-9999}

Informations sur l'historique des encaissements

NPEH1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
NPEH2	Identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
NPEH[3-38]	Solde légal restant dû au mois n	{MONETARY}
NPEH[39-74]	Historique des impayés au mois n	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
NPEH[75-110]	Historique des remboursements — Autres que la vente de sûretés — au mois n	{MONETARY}
NPEH[111-146]	Historique des remboursements — Provenant de la vente de sûretés — au mois n	{MONETARY}

ANNEXE XI

Modèle pour les expositions sous-jacentes — Papier commercial adossé à des actifs

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur les expositions sous-jacentes		
IVAL1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAL2	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAL3	Identifiant initial de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
IVAL4	Nouvel identifiant de l'exposition sous-jacente	{ALPHANUM-1000}
IVAL5	Type d'exposition sous-jacente	{LIST}
IVAL6	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
IVAL7	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 1	{NUTS}
IVAL8	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 2	{NUTS}
IVAL9	Région géographique — Concentration d'expositions la plus élevée 3	{NUTS}
IVAL10	Classification des régions géographiques	{YEAR}
IVAL11	Encours actuel en principal	{MONETARY}
IVAL12	Nombre d'expositions sous-jacentes	{INTEGER-999999999}
IVAL13	Expositions en EUR	{MONETARY}
IVAL14	Expositions en GBP	{MONETARY}
IVAL15	Expositions en USD	{MONETARY}
IVAL16	Autres expositions	{MONETARY}
IVAL17	Échéance résiduelle maximale	{INTEGER-9999}
IVAL18	Échéance résiduelle moyenne	{INTEGER-9999}
IVAL19	Ratio actuel prêt/valeur	{PERCENTAGE}
IVAL20	Ratio de la dette au revenu	{PERCENTAGE}
IVAL21	Type d'amortissement	{MONETARY}
IVAL22	Périodicité prévue pour le remboursement du principal supérieure à un mois	{MONETARY}
IVAL23	Périodicité prévue pour le paiement d'intérêts supérieure à un mois	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
IVAL24	Créances à taux variables	{MONETARY}
IVAL25	Montant financé	{MONETARY}
IVAL26	Dilutions	{MONETARY}
IVAL27	Expositions rachetées	{MONETARY}
IVAL28	Expositions en défaut, ou expositions à un débiteur en difficulté, au moment de la titrisation	{MONETARY}
IVAL29	Expositions en défaut	{MONETARY}
IVAL30	Expositions en défaut CRR	{MONETARY}
IVAL31	Montants bruts radiés au cours de la période	{MONETARY}
IVAL32	Arriérés 1-29 jours	{PERCENTAGE}
IVAL33	Arriérés 30-59 jours	{PERCENTAGE}
IVAL34	Arriérés 60-89 jours	{PERCENTAGE}
IVAL35	Arriérés 90-119 jours	{PERCENTAGE}
IVAL36	Arriérés 120-149 jours	{PERCENTAGE}
IVAL37	Arriérés 150-179 jours	{PERCENTAGE}
IVAL38	Arriérés 180 jours ou +	{PERCENTAGE}
IVAL39	Expositions restructurées	{PERCENTAGE}
IVAL40	Expositions restructurées (0 à 1 an avant transfert)	{MONETARY}
IVAL41	Expositions restructurées (1 à 3 ans avant transfert)	{MONETARY}
IVAL42	Expositions restructurées (plus de 3 ans avant transfert)	{MONETARY}
IVAL43	Expositions restructurées (taux d'intérêt)	{MONETARY}
IVAL44	Expositions restructurées (échéancier de remboursement)	{MONETARY}
IVAL45	Expositions restructurées (structure des échéances)	{MONETARY}
IVAL46	Expositions restructurées (0 à 1 an avant transfert et pas de nouveaux arriérés)	{MONETARY}
IVAL47	Expositions restructurées (pas de nouveaux arriérés)	{MONETARY}
IVAL48	Expositions restructurées (nouveaux arriérés)	{MONETARY}
IVAL49	Expositions restructurées (autre)	{MONETARY}

ANNEXE XII

Modèle pour les rapports destinés aux investisseurs — Titrisation autre que papier commercial adossé à des actifs

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur la titrisation		
IVSS1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
IVSS2	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
IVSS3	Nom de la titrisation	{ALPHANUM-100}
IVSS4	Nom de l'entité déclarante	{ALPHANUM-100}
IVSS5	Personne de contact de l'entité déclarante	{ALPHANUM-256}
IVSS6	Coordonnées téléphoniques de l'entité déclarante	{TELEPHONE}
IVSS7	Coordonnées électroniques de l'entité déclarante	{ALPHANUM-256}
IVSS8	Méthode de rétention du risque	{LIST}
IVSS9	Entité conservant le risque	{LIST}
IVSS10	Type d'exposition sous-jacente	{LIST}
IVSS11	Méthode de transfert du risque	{Y/N}
IVSS12	Mesures/ratios de déclenchement	{Y/N}
IVSS13	Date d'expiration de la période de renouvellement/de démarrage (ramp-up)	{DATEFORMAT}
IVSS14	Recouvrements de principal au cours de la période	{MONETARY}
IVSS15	Recouvrements d'intérêts au cours de la période	{MONETARY}
IVSS16	Encaissements de principal au cours de la période	{MONETARY}
IVSS17	Encaissements d'intérêts au cours de la période	{MONETARY}
IVSS18	Prélèvements sur la facilité de trésorerie	{Y/N}
IVSS19	Marge excédentaire de la titrisation	{MONETARY}
IVSS20	Mécanisme de rétention de la marge excédentaire	{Y/N}
IVSS21	Surcollatéralisation actuelle	{PERCENTAGE}
IVSS22	Taux constant annualisé de remboursement anticipé	{PERCENTAGE}
IVSS23	Dilutions	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
IVSS24	Montants bruts radiés au cours de la période	{MONETARY}
IVSS25	Expositions rachetées	{MONETARY}
IVSS26	Expositions restructurées	{MONETARY}
IVSS27	Taux constant annualisé de défaut	{PERCENTAGE}
IVSS28	Expositions en défaut	{MONETARY}
IVSS29	Expositions en défaut CRR	{MONETARY}
IVSS30	Méthode de pondération du risque	{LIST}
IVSS31	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,00 %, 0,10 %]	{PERCENTAGE}
IVSS32	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,10 %, 0,25 %]	{PERCENTAGE}
IVSS33	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [0,25 %, 1,00 %]	{PERCENTAGE}
IVSS34	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [1,00 %, 7,50 %]	{PERCENTAGE}
IVSS35	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [7,50 %, 20,00 %]	{PERCENTAGE}
IVSS36	Probabilité de défaut du débiteur dans la fourchette [20,00 %, 100,00 %]	{PERCENTAGE}
IVSS37	Estimation interne par la banque de la perte en cas de défaut	{PERCENTAGE}
IVSS38	Arriérés 1-29 jours	{PERCENTAGE}
IVSS39	Arriérés 30-59 jours	{PERCENTAGE}
IVSS40	Arriérés 60-89 jours	{PERCENTAGE}
IVSS41	Arriérés 90-119 jours	{PERCENTAGE}
IVSS42	Arriérés 120-149 jours	{PERCENTAGE}
IVSS43	Arriérés 150-179 jours	{PERCENTAGE}
IVSS44	Arriérés 180 jours ou +	{PERCENTAGE}

Informations sur les tests/événements/déclencheurs

IVSR1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
IVSR2	Identifiant initial du test/événement/déclencheur	{ALPHANUM-1000}
IVSR3	Nouvel identifiant du test/événement/déclencheur	{ALPHANUM-1000}
IVSR4	Description	{ALPHANUM-100000}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
IVSR5	Niveau seuil	{NUMERIC}
IVSR6	Valeur actuelle	{NUMERIC}
IVSR7	Statut	{Y/N}
IVSR8	Période de rétablissement	{INTEGER-9999}
IVSR9	Fréquence de calcul	{INTEGER-9999}
IVSR10	Conséquence en cas de non-conformité	{LIST}

Informations sur les flux de trésorerie

IVSF1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
IVSF2	Identifiant initial de l'élément de flux de trésorerie	{ALPHANUM-1000}
IVSF3	Nouvel identifiant de l'élément de flux de trésorerie	{ALPHANUM-1000}
IVSF4	Élément de flux de trésorerie	{ALPHANUM-1000}
IVSF5	Montant versé au cours de la période	{MONETARY}
IVSF6	Fonds disponibles ex post	{MONETARY}

ANNEXE XIII

Modèle pour les rapports destinés aux investisseurs — Titrisation papier commercial adossé à des actifs

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur le programme		
IVAS1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAS2	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
IVAS3	Nom de l'entité déclarante	{ALPHANUM-100}
IVAS4	Personne de contact de l'entité déclarante	{ALPHANUM-256}
IVAS5	Coordonnées téléphoniques de l'entité déclarante	{TELEPHONE}
IVAS6	Coordonnées électroniques de l'entité déclarante	{ALPHANUM-256}
IVAS7	Mesures/ratios de déclenchement	{Y/N}
IVAS8	Expositions non conformes	{MONETARY}
IVAS9	Durée de vie moyenne pondérée	{INTEGER-9999}
IVAS10	Méthode de rétention du risque	{LIST}
IVAS11	Entité conservant le risque	{LIST}
Informations sur l'opération		
IVAN1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAN2	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAN3	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
IVAN4	Code NACE de l'activité	{NACE}
IVAN5	Méthode de rétention du risque	{LIST}
IVAN6	Entité conservant le risque	{LIST}
IVAN7	Durée de vie moyenne pondérée	{INTEGER-9999}
Informations sur les tests/événements/déclencheurs		
IVAR1	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAR2	Identifiant initial du test/événement/déclencheur	{ALPHANUM-1000}
IVAR3	Nouvel identifiant du test/événement/déclencheur	{ALPHANUM-1000}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
IVAR4	Description	{ALPHANUM-100000}
IVAR5	Statut	{Y/N}
IVAR6	Conséquence en cas de non-conformité	{LIST}

ANNEXE XIV

Modèle pour les informations privilégiées ou les événements importants — Titrisation autre que papier commercial adossé à des actifs

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur la titrisation		
SESS1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESS2	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
SESS3	À cessé d'être STS	{Y/N}
SESS4	Mesures correctives	{Y/N}
SESS5	Mesures administratives	{Y/N}
SESS6	Modification significative des documents concernant l'opération	{ALPHANUM-1000000}
SESS7	Perfection de la cession	{Y/N}
SESS8	Type actuel de cascade	{LIST}
SESS9	Type de fiducie globale (Master Trust)	{LIST}
SESS10	Valeur de la SSPE	{MONETARY}
SESS11	Valeur en principal de la SSPE	{MONETARY}
SESS12	Nombre de comptes de la SSPE	{INTEGER-999999999}
SESS13	Encours en principal des titres	{MONETARY}
SESS14	Part du vendeur	{PERCENTAGE}
SESS15	Part de financement	{PERCENTAGE}
SESS16	Recettes allouées à cette série	{MONETARY}
SESS17	Indice de référence du swap de taux d'intérêt	{LIST}
SESS18	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	{DATEFORMAT}
SESS19	Notionnel du swap de taux d'intérêt	{MONETARY}
SESS20	Monnaie du payeur du swap de devises	{CURRENCYCODE_3}
SESS21	Monnaie du receveur du swap de devises	{CURRENCYCODE_3}
SESS22	Taux de change pour swap de devises	{PERCENTAGE}
SESS23	Date d'échéance du swap de devises	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESS24	Notionnel du swap de devises	{MONETARY}
Informations au niveau des tranches/obligations		
SEST1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SEST2	Identifiant initial de la tranche	{ALPHANUM-1000}
SEST3	Nouvel identifiant de la tranche	{ALPHANUM-1000}
SEST4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	{ISIN}
SEST5	Nom de la tranche	{ALPHANUM-100}
SEST6	Type de tranche/d'obligation	{LIST}
SEST7	Monnaie	{CURRENCYCODE_3}
SEST8	Encours initial en principal	{MONETARY}
SEST9	Encours actuel en principal	{MONETARY}
SEST10	Périodicité de paiement des intérêts	{LIST}
SEST11	Date de paiement des intérêts	{DATEFORMAT}
SEST12	Date de paiement du principal	{DATEFORMAT}
SEST13	Coupon actuel	{PERCENTAGE}
SEST14	Marge/spread de taux d'intérêt actuel	{PERCENTAGE}
SEST15	Plancher du coupon	{PERCENTAGE}
SEST16	Plafond du coupon	{PERCENTAGE}
SEST17	Valeur du coupon augmenté/diminué (Step-Up/Step-Down)	{PERCENTAGE}
SEST18	Date du coupon augmenté/diminué (Step-Up/Step-Down)	{DATEFORMAT}
SEST19	Convention relative aux jours ouvrables	{LIST}
SEST20	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SEST21	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SEST22	Date d'émission	{DATEFORMAT}
SEST23	Date de début de calcul des intérêts	{DATEFORMAT}
SEST24	Date d'échéance légale	{DATEFORMAT}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SEST25	Clause de prolongation	{LIST}
SEST26	Prochaine date de rachat	{DATEFORMAT}
SEST27	Seuil de retrait anticipé (Clean-Up Call)	{ALPHANUM-1000}
SEST28	Prochaine date d'option de vente (Put)	{DATEFORMAT}
SEST29	Convention de calcul des jours	{LIST}
SEST30	Convention de règlement	{LIST}
SEST31	Point d'attachement actuel	{PERCENTAGE}
SEST32	Point d'attachement initial	{PERCENTAGE}
SEST33	Rehaussement de crédit actuel	{PERCENTAGE}
SEST34	Rehaussement de crédit initial	{PERCENTAGE}
SEST35	Formule de rehaussement de crédit	{ALPHANUM-1000}
SEST36	Tranches de rang égal	{ISIN}
SEST37	Tranches de rang supérieur	{ISIN}
SEST38	Encours inscrit au registre des impayés en principal	{MONETARY}
SEST39	Identifiant d'entité juridique du garant	{LEI}
SEST40	Nom du garant	{ALPHANUM-1000}
SEST41	Sous-secteur SEC du garant	{ESA}
SEST42	Type de protection	{LIST}

Informations au niveau du compte

SESA1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESA2	Identifiant initial du compte	{ALPHANUM-1000}
SESA3	Nouvel identifiant du compte	{ALPHANUM-1000}
SESA4	Type de compte	{LIST}
SESA5	Solde cible du compte	{MONETARY}
SESA6	Solde effectif du compte	{MONETARY}
SESA7	Amortissement du compte	{Y/N}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations au niveau de la contrepartie		
SESP1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESP2	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie	{LEI}
SESP3	Nom de la contrepartie	{ALPHANUM-100}
SESP4	Type de contrepartie	{LIST}
SESP5	Pays d'établissement de la contrepartie	{COUNTRYCODE_2}
SESP6	Seuil de notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100000}
SESP7	Notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100000}
SESP8	Identifiant d'entité juridique de la source de la notation de la contrepartie	{LEI}
SESP9	Nom de la source de la notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100}
Informations sur les titrisations CLO		
SESC1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESC2	Date de fin de la période sans rachat (Non-Call)	{DATEFORMAT}
SESC3	Type de CLO	{LIST}
SESC4	Période actuelle	{LIST}
SESC5	Date de début de la période actuelle	{DATEFORMAT}
SESC6	Date de fin de la période actuelle	{DATEFORMAT}
SESC7	Limite de concentration	{PERCENTAGE}
SESC8	Restrictions — Échéance légale	{PERCENTAGE}
SESC9	Restrictions — Expositions subordonnées	{PERCENTAGE}
SESC10	Restrictions — Expositions non performantes	{PERCENTAGE}
SESC11	Restrictions — Expositions PIK	{PERCENTAGE}
SESC12	Restrictions — Expositions coupon zéro	{PERCENTAGE}
SESC13	Restrictions — Expositions actions	{PERCENTAGE}
SESC14	Restrictions — Expositions participations	{PERCENTAGE}
SESC15	Restrictions — Ventes discrétionnaires	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESC16	Ventes discrétionnaires	{MONETARY}
SESC17	Réinvestissements	{MONETARY}
SESC18	Restrictions — Rehaussement de crédit	{Y/N}
SESC19	Restrictions — Offres de prix	{Y/N}
SESC20	Restrictions — Transactions	{Y/N}
SESC21	Restrictions — Émissions	{Y/N}
SESC22	Restrictions — Remboursements	{Y/N}
SESC23	Restrictions — Refinancement	{Y/N}
SESC24	Restrictions — Rémunération titres	{Y/N}
SESC25	Restrictions — Protection de crédit	{Y/N}
SESC26	Délai de liquidation des sûretés	{INTEGER-9999}
SESC27	Liquidation des sûretés — Renoncement	{Y/N}

Informations sur le gestionnaire de CLO

SESL1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESL2	Identifiant d'entité juridique du gestionnaire de CLO	{LEI}
SESL3	Nom du gestionnaire	{ALPHANUM-1000}
SESL4	Date d'établissement	{DATEFORMAT}
SESL5	Date d'enregistrement	{DATEFORMAT}
SESL6	Salariés	{INTEGER-9999}
SESL7	Salariés — CLO	{INTEGER-9999}
SESL8	Salariés — Restructuration crédits	{INTEGER-9999}
SESL9	Actifs sous gestion	{MONETARY}
SESL10	Actifs sous gestion — Prêts à effet de levier	{MONETARY}
SESL11	Actifs sous gestion — CLO	{MONETARY}
SESL12	Actifs sous gestion — UE	{MONETARY}
SESL13	Actifs sous gestion — CLO UE	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESL14	Nombre de CLO UE	{INTEGER-9999}
SESL15	Capital	{MONETARY}
SESL16	Capital — Rétention du risque	{MONETARY}
SESL17	Durée de règlement	{INTEGER-9999}
SESL18	Fréquence de détermination du prix	{INTEGER-9999}
SESL19	Taux de défaut — 1 an	{PERCENTAGE}
SESL20	Taux de défaut — 5 ans	{PERCENTAGE}
SESL21	Taux de défaut — 10 ans	{PERCENTAGE}

Informations sur la couverture synthétique

SESV1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESV2	Identifiant de l'instrument de protection	{ALPHANUM-1000}
SESV3	Type de protection	{LIST}
SESV4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) de l'instrument de protection	{ISIN}
SESV5	Nom du fournisseur de protection	{ALPHANUM-100}
SESV6	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de protection	{LEI}
SESV7	Entité publique dont la pondération de risque est zéro	{Y/N}
SESV8	Droit applicable	{COUNTRYCODE_2}
SESV9	Convention-cadre ISDA (ISDA Master Agreement)	{LIST}
SESV10	Événements de défaut et de résiliation	{LIST}
SESV11	Type de titrisation synthétique	{Y/N}
SESV12	Monnaie de la protection	{CURRENCYCODE_3}
SESV13	Notionnel actuel de la protection	{MONETARY}
SESV14	Notionnel maximum de la protection	{MONETARY}
SESV15	Point d'attachement de la protection	{PERCENTAGE}
SESV16	Point de détachement de la protection	{PERCENTAGE}
SESV17	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) des titres couverts	{ISIN}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESV18	Couverture de la protection	{LIST}
SESV19	Date de fin de la protection	{DATEFORMAT}
SESV20	Seuils d'importance significative	{Y/N}
SESV21	Conditions de libération des paiements	{LIST}
SESV22	Possibilité de paiements à des fins d'ajustement	{Y/N}
SESV23	Durée de la période de restructuration	{INTEGER-9999}
SESV24	Obligation de rembourser	{Y/N}
SESV25	Possibilité de remplacement des sûretés	{Y/N}
SESV26	Exigences en matière de couverture des sûretés	{PERCENTAGE}
SESV27	Marge initiale des sûretés	{MONETARY}
SESV28	Délai de livraison des sûretés	{INTEGER-9999}
SESV29	Règlement	{LIST}
SESV30	Date d'échéance maximale autorisée	{DATEFORMAT}
SESV31	Indice de référence actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	{LIST}
SESV32	Échéance de l'indice de référence actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	{LIST}
SESV33	Fréquence de redéfinition des paiements — À l'acheteur de protection	{LIST}
SESV34	Marge de taux d'intérêt actuelle pour les paiements à l'acheteur de protection	{PERCENTAGE}
SESV35	Taux d'intérêt actuel pour les paiements à l'acheteur de protection	{PERCENTAGE}
SESV36	Indice de référence actuel pour les paiements — Au vendeur de protection	{LIST}
SESV37	Échéance de l'indice de référence actuel pour les paiements au vendeur de protection	{LIST}
SESV38	Fréquence de redéfinition des paiements au vendeur de protection	{LIST}
SESV39	Marge de taux d'intérêt actuelle pour les paiements au vendeur de protection	{PERCENTAGE}
SESV40	Taux d'intérêt actuel pour les paiements au vendeur de protection	{PERCENTAGE}
SESV41	Soutien de la marge excédentaire	{Y/N}
SESV42	Définition de la marge excédentaire	{Y/N}
SESV43	Statut actuel de la protection	{LIST}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESV44	Faillite en tant qu'événement de crédit	{Y/N}
SESV45	Défaut de paiement en tant qu'événement de crédit	{Y/N}
SESV46	Restructuration en tant qu'événement de crédit	{Y/N}
SESV47	Événement de crédit	{Y/N}
SESV48	Paiements cumulés à l'acheteur de protection	{MONETARY}
SESV49	Paiements d'ajustement cumulés à l'acheteur de protection	{MONETARY}
SESV50	Paiements cumulés au vendeur de protection	{MONETARY}
SESV51	Paiements d'ajustement cumulés au vendeur de protection	{MONETARY}
SESV52	Montant du registre de marge excédentaire synthétique	{MONETARY}
Informations sur l'émetteur des sûretés		
SESI1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESI2	Identifiant de l'instrument de protection	{ALPHANUM-1000}
SESI3	Identifiant initial de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
SESI4	Nouvel identifiant de la sûreté	{ALPHANUM-1000}
SESI5	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières) de la sûreté	{ISIN}
SESI6	Type de sûreté	{LIST}
SESI7	Sous-secteur SEC de l'émetteur des sûretés	{ESA}
SESI8	Identifiant d'entité juridique de l'émetteur des sûretés	{LEI}
SESI9	Émetteur des sûretés affilié à l'initiateur?	{Y/N}
SESI10	Encours actuel	{MONETARY}
SESI11	Monnaie de l'instrument	{CURRENCYCODE_3}
SESI12	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
SESI13	Décote	{PERCENTAGE}
SESI14	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SESI15	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SESI16	Taux d'intérêt actuel sur les dépôts en espèces	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SESI17	Nom de la contrepartie à l'accord de mise en pension	{ALPHANUM-100}
SESI18	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie à l'accord de mise en pension	{LEI}
SESI19	Date d'échéance de l'accord de mise en pension	{DATEFORMAT}

Autres informations

SESO1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SESO2	Numéro de ligne des autres informations	{INTEGER-9999}
SESO3	Autres informations	{ALPHANUM-1000}

ANNEXE XV

Modèle pour les informations privilégiées ou les évènements importants — Titrisation papier commercial adossé à des actifs

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Informations sur le programme		
SEAS1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAS2	Date d'arrêté des données	{DATEFORMAT}
SEAS3	À cessé d'être STS	{Y/N}
SEAS4	Mesures correctives	{Y/N}
SEAS5	Mesures administratives	{Y/N}
SEAS6	Modification significative des documents concernant l'opération	{ALPHANUM-100000}
SEAS7	Droit applicable	{COUNTRYCODE_2}
SEAS8	Durée de la facilité de trésorerie	{INTEGER-9999}
SEAS9	Couverture de la facilité de trésorerie	{PERCENTAGE}
SEAS10	Intervalle de la facilité de trésorerie	{INTEGER-9999}
SEAS11	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	{DATEFORMAT}
SEAS12	Prélèvements sur la facilité de trésorerie	{Y/N}
SEAS13	Émissions totales	{MONETARY}
SEAS14	Émissions maximales	{MONETARY}
Informations sur l'opération		
SEAR1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAR2	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAR3	Nombre de programmes finançant l'opération	{INTEGER-9999}
SEAR4	À cessé d'être STS	{Y/N}
SEAR5	Initiateur client du sponsor du programme	{Y/N}
SEAR6	Sûreté accordée	{Y/N}
SEAR7	Revenus	{MONETARY}
SEAR8	Charges d'exploitation	{MONETARY}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SEAR9	Actifs actuels	{MONETARY}
SEAR10	Espèces	{MONETARY}
SEAR11	Titres négociables	{MONETARY}
SEAR12	Créances	{MONETARY}
SEAR13	Passifs actuels	{MONETARY}
SEAR14	Total des dettes	{MONETARY}
SEAR15	Total des capitaux propres	{MONETARY}
SEAR16	Monnaie d'établissement des états financiers	{CURRENCYCODE_3}
SEAR17	Le sponsor soutient l'opération	{LIST}
SEAR18	Type de soutien du sponsor	{Y/N}
SEAR19	Durée de la facilité de trésorerie	{INTEGER-9999}
SEAR20	Montant prélevé sur la facilité de trésorerie	{MONETARY}
SEAR21	Couverture de la facilité de trésorerie	{PERCENTAGE}
SEAR22	Intervalle de la facilité de trésorerie	{INTEGER-9999}
SEAR23	Type de facilité de trésorerie	{LIST}
SEAR24	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	{DATEFORMAT}
SEAR25	Monnaie de la facilité de trésorerie	{CURRENCYCODE_3}
SEAR26	Date d'échéance de la facilité de trésorerie	{DATEFORMAT}
SEAR27	Nom du fournisseur de la facilité de trésorerie	{ALPHANUM-100}
SEAR28	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de la facilité de trésorerie	{LEI}
SEAR29	Surcollatéralisation/Intérêt subordonné	{PERCENTAGE}
SEAR30	Marge excédentaire de l'opération	{MONETARY}
SEAR31	Nom du fournisseur de la lettre de crédit	{ALPHANUM-100}
SEAR32	Identifiant d'entité juridique du fournisseur de la lettre de crédit	{LEI}
SEAR33	Monnaie de la lettre de crédit	{CURRENCYCODE_3}
SEAR34	Protection maximale de la lettre de crédit	{PERCENTAGE}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SEAR35	Nom du garant	{ALPHANUM-100}
SEAR36	Identifiant d'entité juridique du garant	{LEI}
SEAR37	Couverture maximale de la garantie	{MONETARY}
SEAR38	Monnaie de la garantie	{CURRENCYCODE_3}
SEAR39	Date d'échéance de la garantie	{DATEFORMAT}
SEAR40	Type de transfert des créances	{LIST}
SEAR41	Date d'échéance de l'accord de mise en pension	{DATEFORMAT}
SEAR42	Montant acheté	{MONETARY}
SEAR43	Limite maximale de financement	{MONETARY}
SEAR44	Indice de référence du swap de taux d'intérêt	{LIST}
SEAR45	Date d'échéance du swap de taux d'intérêt	{DATEFORMAT}
SEAR46	Notionnel du swap de taux d'intérêt	{MONETARY}
SEAR47	Monnaie du payeur du swap de devises	{CURRENCYCODE_3}
SEAR48	Monnaie du receveur du swap de devises	{CURRENCYCODE_3}
SEAR49	Taux de change pour swap de devises	{PERCENTAGE}
SEAR50	Date d'échéance du swap de devises	{DATEFORMAT}
SEAR51	Notionnel du swap de devises	{MONETARY}

Informations au niveau des tranches/obligations

SEAT1	Identifiant unique — Programme ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAT2	Identifiant initial de l'obligation	{ALPHANUM-1000}
SEAT3	Nouvel identifiant de l'obligation	{ALPHANUM-1000}
SEAT4	Code ISIN (numéro international d'identification des valeurs mobilières)	{ISIN}
SEAT5	Type de tranche/d'obligation	{LIST}
SEAT6	Date d'émission	{DATEFORMAT}
SEAT7	Date d'échéance légale	{DATEFORMAT}
SEAT8	Monnaie	{CURRENCYCODE_3}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
SEAT9	Encours actuel en principal	{MONETARY}
SEAT10	Coupon actuel	{PERCENTAGE}
SEAT11	Indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SEAT12	Échéance de l'indice de référence du taux d'intérêt actuel	{LIST}
SEAT13	Périodicité de paiement des intérêts	{LIST}
SEAT14	Rehaussement de crédit actuel	{PERCENTAGE}
SEAT15	Formule de rehaussement de crédit	{ALPHANUM-1000}

Informations au niveau du compte

SEAA1	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAA2	Identifiant initial du compte	{ALPHANUM-1000}
SEAA3	Nouvel identifiant du compte	{ALPHANUM-1000}
SEAA4	Type de compte	{LIST}
SEAA5	Solde cible du compte	{MONETARY}
SEAA6	Solde effectif du compte	{MONETARY}
SEAA7	Amortissement du compte	{Y/N}

Informations au niveau de la contrepartie

SEAP1	Identifiant unique — Opération ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAP2	Identifiant d'entité juridique de la contrepartie	{LEI}
SEAP3	Nom de la contrepartie	{ALPHANUM-100}
SEAP4	Type de contrepartie	{LIST}
SEAP5	Pays d'établissement de la contrepartie	{COUNTRYCODE_2}
SEAP6	Seuil de notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100000}
SEAP7	Notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100000}
SEAP8	Identifiant d'entité juridique de la source de la notation de la contrepartie	{LEI}
SEAP9	Nom de la source de la notation de la contrepartie	{ALPHANUM-100}

CODE DU CHAMP	NOM DU CHAMP	FORMAT
Autres informations		
SEAO1	Identifiant unique	{ALPHANUM-28}
SEAO2	Numéro de ligne des autres informations	{INTEGER-9999}
SEAO3	Autres informations	{ALPHANUM-1000}