

6.2

Réglementation et instructions générales

6.2 RÉGLEMENTATION ET INSTRUCTIONS GÉNÉRALES

6.2.1 Consultation

Aucune information.

6.2.2 Publication

DÉCISION N° 2026-PDG-0039

Modification de l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés*

Vu le pouvoir de l'Autorité des marchés financiers (l'« AMF »), prévu à l'article 96 de la *Loi sur les instruments dérivés*, RLRQ, c. I-14.01 (la « LID »), d'établir des instructions générales qui indiquent comment l'AMF entend exercer ses pouvoirs discrétionnaires aux fins de l'administration de la LID;

Vu le pouvoir de l'AMF d'établir une instruction générale prévu à la LID, qui appartient exclusivement à son président-directeur général, conformément à l'article 24 de la *Loi sur l'encadrement du secteur financier*, RLRQ, c. E-6.1;

Vu la décision n° 2024-PDG-0047 par laquelle l'AMF a établi l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* (l'« Instruction générale »);

Vu la volonté de l'AMF de revoir l'Instruction générale et la nécessité d'y apporter des modifications aux fins d'harmonisation;

Vu le projet de modification de l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés*, présenté par la Direction principale de l'encadrement des marchés et des dérivés et des affaires internationales ainsi que la recommandation du surintendant des marchés de valeurs et de la distribution de l'approuver et d'autoriser sa publication;

En conséquence :

L'AMF établit la modification de l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés*, dans ses versions française et anglaise, dont les textes sont annexés à la présente décision, et autorise sa publication au Bulletin.

La modification de l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* prend effet le 11 août 2027.

Fait le 5 août 2026.

Yves Ouellet
Président-directeur général



Canadian Securities Administrators
Autorités canadiennes en valeurs mobilières

Avis de publication multilatéral des ACVM

Modification de la Companion Policy 96-101 Derivatives: Trade Reporting et de l'Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés

Le 11 août 2026

Introduction

Aujourd'hui, les autorités membres des Autorités en valeurs mobilières du Canada (les **ACVM**) du Québec, de l'Alberta, de la Colombie-Britannique, du Nouveau-Brunswick, de Terre-Neuve-et-Labrador, des Territoires du Nord-Ouest, de la Nouvelle-Écosse, du Nunavut, de l'Île-du-Prince-Édouard, de la Saskatchewan et du Yukon (collectivement, les **autorités participantes** ou **nous**) annoncent des modifications aux textes suivants :

- l'*Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* (**l'IG 91-507**);
- la Companion Policy 96-101, *Derivatives: Trade Reporting* (la **CP 96-101**).

Ces modifications entreront en vigueur le 11 août 2027.

Objet

Des modifications sont apportées à l'IG 91-507 et à la CP 96-101 afin que les participants au marché disposent de la version mise à jour du *Manuel technique des données sur les dérivés* des ACVM (le **Manuel**). Ces modifications comprennent les spécifications techniques relatives à la définition, au format et aux valeurs autorisées pour chaque élément de données dont la déclaration est obligatoire en vertu du *Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés*, au Québec, et du Multilateral Instrument 96-101 *Derivatives: Trade Reporting*, dans les territoires des autres autorités participantes. Elles visent à améliorer la normalisation et l'harmonisation des éléments de données.

Contexte

Une première version du Manuel a été publiée le 25 juillet 2024.

-2-

Le personnel entend y apporter périodiquement des modifications, notamment pour tenir compte des spécifications techniques des organismes internationaux de normalisation et de réglementation.

Résumé des modifications

Les annexes suivantes, qui présentent les modifications apportées au Manuel, sont jointes au présent avis :

- Annexe A : Pour le Québec, la modification de l'IG 91-507
- Annexe B : Pour les autorités participantes autres que le Québec, la modification de la CP 96-101
- Annexe C : Pour toutes les autorités participantes, la version soulignée du Manuel indiquant les changements

Questions

Les intéressés sont invités à transmettre toute question ou tout commentaire.

Veuillez poser vos questions à l'une des personnes suivantes :

Yasmine Garreau

Analyste experte à la réglementation
Direction de l'encadrement des marchés et
des dérivés et des affaires internationales
yasmine.garreau@lautorite.qc.ca

Janice Cherniak

Senior Legal Counsel
Alberta Securities Commission
janice.cherniak@asc.ca

Michael Brady

Deputy Director, CMR
BC Securities Commission
mbrady@bcsc.bc.ca

Doug Harris

General Counsel, Director of Market
Regulation and Policy and Secretary
Nova Scotia Securities Commission
doug.harris@novascotia.ca

Caroline Smith

Senior Legal Counsel
Financial and Consumer Affairs Authority of
Saskatchewan
caroline.smith@gov.sk.ca

Ray Burke

Responsable, Financement des sociétés
Commission des services financiers et des
services aux consommateurs du
Nouveau-Brunswick
ray.burke@fcnb.ca

Annexe A

MODIFICATION DE L'INSTRUCTION GÉNÉRALE RELATIVE AU RÈGLEMENT 91-507 SUR LES RÉFÉRENTIELS CENTRAUX ET LA DÉCLARATION DE DONNÉES SUR LES DÉRIVÉS

1. L'Annexe A de l'Instruction générale relative au Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données est remplacée par la suivante :

« **Annexe A**

Manuel technique des données sur les dérivés

**Spécifications techniques concernant la
déclaration des données sur les dérivés de
gré à gré**

Le 11 août 2026

Version 2.0

Historique du document

Révisions

Date	Version	Description
2024-07-25	1.0	Première publication accompagnant des modifications des règlements sur la déclaration des opérations
2026-08-11	2.0	Seconde publication avec modifications

Sommaire

1	INTRODUCTION	5
1.1	Contexte	5
1.1.1	Format des spécifications techniques	5
1.2	Explication de certains éléments de données ou catégories de données	7
1.2.1	Sens de la transaction	7
1.2.2	Éléments de données répétés ou produits à branches multiples	7
1.2.3	Tableaux	7
1.2.4	Actions et événements	8
1.2.5	Validations	8
1.2.6	Champs Identifiant du sous-jacent (Autre)	9
1.2.7	Champs relatifs aux autres paiements	10
1.2.8	Paquets de dérivés	10
1.2.9	Déclaration des positions	10
1.2.10	UTI antérieur	11
1.3	Dérivés préalablement existants	11
2	SPÉCIFICATIONS TECHNIQUES	12
2.1	Lignes directrices pour la déclaration des positions	64
3	ANNEXE	69
3.1	Montant notionnel	69
3.2	Mise en correspondance des valeurs autorisées par la convention de calcul des jours avec les valeurs ISO 20022, FpML et FIX/FIXML	70
3.3	Méthode de valorisation	78
3.4	Catégorie de sûreté	79
3.5	Déclaration des actions et des événements	79

3.6	Séquence autorisée des actions du cycle de vie	81
3.7	Définitions des valeurs autorisées pour les types d'événement	82
3.8	Définitions des valeurs autorisées pour les types d'action	83
3.9	Valeurs autorisées pour l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »	84
3.10	Valeurs autorisées pour la source de l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »	86
4	EXEMPLES	87
4.1	Transactions sur plateforme d'exécution de swaps – anonymes et compensées	87
4.2	Paquet – prix/écart	87
4.3	Résiliation/modification partielle, correction	88
4.4	Affectation (ALOC)	88
4.5	Position	88
4.5a	Position intrajournalière	89
4.6	Erreur et relance	90
4.7	Dérivé sur cryptoactifs	90
4.8	Mise à niveau	90

1 Introduction

1.1 Contexte

Le présent manuel (*Manuel technique des données sur les dérivés* des ACVM, appelé ci-après le **Manuel technique**) énonce les spécifications relatives à la définition, au format et aux valeurs autorisées pour chaque élément de données dont la déclaration est obligatoire en vertu de la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba, de la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario, du *Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* du Québec et, dans les provinces et territoires non mentionnés ici, de la *Norme multilatérale 96-101 sur la déclaration des opérations sur dérivés* (collectivement appelés ci-après les **règlements sur la déclaration des opérations**). Ces spécifications sont principalement tirées du document *Revised CDE Technical Guidance – version 4: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*¹ (appelé ci-après les **orientations techniques CDE**).

Le *Manuel technique* est destiné à aider les intervenants sur le marché à déclarer leurs données conformément aux règlements sur la déclaration des opérations qui sont entrés en vigueur le 25 juillet 2025.

À moins d'indication contraire dans le *Manuel technique* ou que la situation ne s'y prête pas, tout terme employé dans le *Manuel technique* et défini dans l'une ou l'autre des règlements sur la déclaration des opérations s'entend au sens de cette règle.

En général, lorsqu'un élément de données correspond aux prescriptions de la Commodity Futures Trading Commission (la **CFTC**), le *Manuel technique* emploie le même nom, la même définition, le même format et les mêmes valeurs autorisées que la CFTC.

Il est prévu que le *Manuel technique* soit périodiquement actualisé en fonction des mises à jour apportées par les Autorités canadiennes en valeurs mobilières (**ACVM**) et les instances internationales.

1.1.1 Format des spécifications techniques

- 1) **#** : un numéro est attribué à tous les éléments de données pour faciliter la consultation. Il est fait référence à ce numéro dans l'ensemble du *Manuel technique* et dans l'annexe A de chacun des règlements sur la déclaration des opérations.
- 2) **Source** : cette colonne contient la mention « CDE », « ACVM », « CFTC » ou « AEMF ». « CDE » indique un élément de données tiré des orientations techniques CDE, « CFTC », un élément de données provenant de la Commodity Futures Trading Commission et « AEMF », un élément de données provenant de l'Autorité européenne des marchés financiers.
- 3) **Catégorie** : les éléments de données sont regroupés par thème ou catégorie.
- 4) **Description de l'élément de données** : la brève description de l'élément de données qui est fournie dans l'annexe A de chacun des règlements sur la déclaration des opérations est reproduite dans le *Manuel technique* pour des raisons de commodité. Les descriptions sont rédigées de manière à respecter les normes de rédaction des règlements des ACVM tout en concordant en substance avec l'explication détaillée correspondante.
- 5) **Explication détaillée de l'élément de données** : pour les éléments de données « CDE », les explications proviennent des orientations techniques CDE, et des notes de bas de page ont été ajoutées pour donner des éclaircissements en fonction des règlements de la CFTC. Pour les éléments de données CFTC, les explications proviennent des spécifications techniques de la CFTC, et de notes de bas de page ont été ajoutées pour donner des éclaircissements. Pour les éléments de données « AEMF », les explications proviennent des règles de validation REFIT de l'AEMF. Les éléments de données dont la source est la CFTC ou l'AEMF valent sans égard aux obligations de déclaration américaines ou européennes. Par exemple, les éléments de données de source CFTC ne valent pas

¹ Voir *Revised CDE Technical Guidance – version 4 - Harmonisation of critical OTC derivative data elements (other than UTI and UPI)*, décembre 2025, https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf.

uniquement pour les swaps visés par les règles de la CFTC, mais bien pour tous les dérivés devant être déclarés selon les règlements sur la déclaration des opérations, qu'ils le soient ou non selon les règles de la CFTC.

6) **Format** : voir le tableau ci-dessous pour la signification des formats utilisés dans le présent document.

Format	Contenu en bref	Explication complémentaire	Exemple(s)
AAAA-MM-JJ	Date	AAAA = quatre chiffres représentant l'année. MM = deux chiffres représentant le mois. JJ = deux chiffres représentant le jour.	2015-07-06 (Désigne le 6 juillet 2015)
AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	Date et heure	AAAA, MM, JJ comme ci-dessus. hh = deux chiffres représentant l'heure (00 à 23) (le format AM/PM n'est PAS autorisé). mm = deux chiffres représentant les minutes (00 à 59). ss = deux chiffres représentant les secondes (00 à 59). T est une constante et indique le début de l'élément « heure ». Z est une constante et indique que les heures sont exprimées en UTC (temps universel coordonné) et non en heure locale.	2014-11-05T13:15:30Z (désigne le 5 novembre 2014, 13 h 15 min 30 s, UTC, ou le 5 novembre 2014, 8 h 15 min 30 s, heure normale de l'est des États-Unis)
Num(25,5)	Jusqu'à 25 caractères numériques comprenant jusqu'à cinq décimales.	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à 25 caractères numériques, dont jusqu'à cinq caractères numériques après la virgule. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après la virgule, les contreparties déclarantes doivent arrondir à la moitié supérieure.	1352,67 12345678901234567890,12345 1234567890123456789012345 0 - 20000,25 - 0,257
Num(5)²	Jusqu'à cinq caractères numériques; les décimales ne sont pas autorisées.	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à cinq caractères numériques	12345 123 20
Char(3)	Trois caractères alphanumériques	La longueur est fixée à trois caractères alphanumériques.	USD X1X 999
Varchar(25)	Jusqu'à 25 caractères alphanumériques	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à 25 caractères alphanumériques. Aucun caractère spécial n'est autorisé. S'ils sont autorisés, cela sera explicitement indiqué dans le format de l'élément de données.	asgaGEH3268EFdsagtTRCF543 aaaaaaaaa x
Booléen	Caractères booléens	« Vrai » ou « Faux » ou encore « vrai » ou « faux » ³	Vrai/vrai Faux/faux

Tableau 1 – Explication des formats utilisés dans les spécifications techniques

² Le format Num(5) est équivalent au format Num(5,0) utilisé dans le présent manuel, mais ne permet pas l'emploi de décimales.

³ Les majuscules comme les minuscules sont acceptées tant que les ACVM n'ont pas adopté la norme de messagerie ISO 20022.

1.2 Explication de certains éléments de données ou catégories de données

1.2.1 Sens de la transaction

Le *Manuel technique* exige la déclaration de l'acheteur/du vendeur ou du payeur/du receveur pour cet élément de données. Il s'agit d'une approche légèrement différente de celle des orientations techniques CDE, qui prévoient deux options de déclaration du sens de la transaction. La contrepartie déclarante n'a pas à déclarer à la fois l'acheteur/le vendeur et le payeur/le receveur pour une transaction donnée; elle emploie la méthode de déclaration appropriée au type d'instrument déclaré.

1.2.2 Éléments de données répétés ou produits à branches multiples

Un produit à branches ou flux multiples pourrait être déclaré plus d'une fois au moyen d'un même élément de données; cela dépend du produit déclaré et de la convention de marché qui s'y rattache. Pour qu'un produit puisse être déclaré plus d'une fois au moyen d'un même élément de données, il doit être coté à titre de branche. Si le concept de branches ou flux multiples ne s'applique pas au produit, déclarer les valeurs dans l'élément de données correspondant à la première branche (branche 1) pour tous les champs spécifiés comme se rapportant aux produits à branches multiples. Pour les produits comportant deux branches dont l'une fait référence à une valeur fixe et l'autre, à une valeur variable, les éléments relatifs à la branche 1 doivent concerner la branche qui fait référence à la valeur fixe et les éléments relatifs à la branche 2 doivent concerner la branche qui fait référence à la valeur variable. Pour les produits comportant deux branches faisant référence chacune à une valeur variable différente, l'ordre des branches doit correspondre à l'ordre alphabétique de leurs sous-jacents respectifs. Si les sous-jacents en question portent un même nom, mais se différencient par leur durée, les éléments relatifs à la branche 1 doivent concerner le sous-jacent qui a la durée la plus courte.

1.2.3 Tableaux

Les données relatives aux dérivés auxquels sont associés des tableaux doivent être déclarées en tant que données à communiquer à l'exécution si les renseignements sont connus au moment de l'exécution de la transaction, ou dans le cadre d'un événement du cycle de vie lorsque les valeurs en question deviennent connues pendant la durée de vie de la transaction. Lorsque plusieurs valeurs doivent être déclarées dans un même champ, il est possible de placer un délimiteur entre ces valeurs. Le choix du délimiteur est laissé à la discrétion du référentiel central, mais le même délimiteur doit être utilisé de façon uniforme dans tous les fichiers. Le format et les valeurs permises qui figurent dans le tableau 2 s'appliquent à chaque valeur individuelle au sein d'un champ de tableau plutôt qu'au champ délimité. Chaque entrée doit, de façon indépendante, respecter le format et les règles de validation applicables à l'élément de données.

Les champs de tableau doivent contenir le même nombre d'entrées dans tous les champs connexes, et les entrées doivent être placées en ordre chronologique de date de prise d'effet. La diffusion publique est obligatoire pour les 10 premières valeurs des champs de tableau.

De multiples valeurs peuvent être déclarées à l'égard des éléments de données suivants :

- 10 Territoire de la contrepartie 1
- 11 Territoire de la contrepartie 2
- 37 Tableau de la quantité notionnelle – date de prise d'effet
- 38 Tableau de la quantité notionnelle – date de fin
- 39 Tableau de la quantité notionnelle – quantité notionnelle
- 40 Tableau de montants notionnels – montant notionnel
- 41 Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet
- 42 Tableau de montants notionnels – date de fin
- 50 Tableau de prix – date de prise d'effet
- 51 Tableau de prix – date de fin
- 52 Tableau de prix – prix
- 65 Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet
- 66 Tableau de prix d'exercice – date de fin
- 67 Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice
- 77 Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1
- 78 Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2
- 124 Identifiant des composantes du panier
- 125 Source de l'identifiant des composantes du panier
- 126 Nombre d'unités des composantes du panier
- 127 Unité de mesure des composantes du panier
- 136 Montant de l'autre paiement
- 137 Monnaie de l'autre paiement
- 138 Date de l'autre paiement
- 139 Payeur de l'autre paiement
- 140 Receveur de l'autre paiement
- 141 Type de l'autre paiement

1.2.4 Actions et événements

L'Annexe 3.5 montre comment présenter les différents événements dans les déclarations de transactions, de positions et de fin de journée (valorisation et sûretés).

Il faut au moins déclarer tout élément de données touché par des actions ou des événements. Il revient au référentiel central de juger de la pertinence d'inclure d'autres éléments dans les messages qui se rapportent aux événements.

Les corrections portant sur la valorisation et les sûretés sont permises. Elles doivent être déclarées au moyen des types d'action « VALU » et « MARU ».

1.2.5 Validations

De manière générale, les validations sont censées être les mêmes que celles prévues par la CFTC dans ses obligations de déclaration des données à la Partie 45 dans le cas où l'élément de données du *Manuel technique* serait également requis par la CFTC. Il est loisible au référentiel central de limiter le nombre d'éléments de données à transmettre pour les types d'action « TERM », « PRTO » et « EROR ».

Types de déclarations

Transaction = données à communiquer à l'exécution et données sur les événements du cycle de vie. On entend par « transaction » la conclusion, la cession, la vente ou toute autre forme d'acquisition ou d'aliénation d'un dérivé ou la novation d'un dérivé. D'après les règlements sur la déclaration des opérations, chaque transaction est à déclarer comme un dérivé unique.

Valorisation = données de valorisation. On entend par « données de valorisation » les données qui indiquent la valeur actuelle du dérivé et qui comprennent les données visées dans les éléments de la rubrique «Éléments de données relatifs à la valorisation» de l'annexe A.

Sûretés = données sur les marges. On entend par « données sur les sûretés et les marges » les données correspondant aux montants actuels de sûreté et de marge déposées ou collectées qui sont visés dans les éléments de la rubrique « Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges » de l'annexe.

Valeurs

O = obligatoire (L'élément de données est obligatoire et les règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées, doivent aussi être suivies.)

C = conditionnel (L'élément de données est requis si les conditions énoncées dans les règles de validation sont réunies. Les règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées, doivent aussi être suivies.)

NR = non requis (L'élément de données n'est pas requis dans la déclaration.)

F = facultatif (L'élément de données est à déclarer **s'il s'applique** au dérivé. Son utilisation peut être soumise à l'application de règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées.)

Exemple :

« Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide} » signifie

Transaction – C (conditionnel) :

Ce champ est **O (obligatoire)** si à la fois le champ [Identifiant du payeur] et le champ [Identifiant du receveur] ne sont **pas utilisés**. Sinon, le laisser **vide**.

« Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {facultatif} » signifie

Transaction – C (conditionnel) :

Ce champ est **O (obligatoire)** si à la fois le champ [Identifiant du payeur] et le champ [Identifiant du receveur] ne sont **pas utilisés**. Autrement, le champ est **F (facultatif)** (c.-à-d. qu'il peut être inclus s'il est applicable au dérivé).

Éléments de données par branche

Si un élément de données est à branches multiples et que le tableau 2 ne contient pas de validations propres à chaque branche, les validations visent à s'appliquer par défaut à la première branche (branche 1). On ne peut présumer qu'elles s'appliquent à la seconde branche (branche 2), en grande partie en raison de la conditionnalité qui existe entre les champs qui concernent les branches et du fait que les éléments de données propres à un référentiel central peuvent avoir sur le fonctionnement des validations publiées des effets qui ne sont pas prévus dans le *Manuel technique*. C'est pourquoi les référentiels centraux peuvent incorporer des validations supplémentaires à l'égard des éléments de données par branche lorsqu'ils l'estiment nécessaire.

1.2.6 Champs Identifiant du sous-jacent (Autre)

Éléments de données relatifs à l'actif sous-jacent

Les éléments de données de cette série servent à communiquer les informations relatives aux sous-jacents lorsqu'elles ne peuvent être dérivées de l'UPI. Ces éléments de données s'appliquent aux actifs de toute catégorie et doivent être fournis à l'appui de tout sous-jacent.

- Les éléments de données 128 et 129 sont à déclarer lorsque le fournisseur de services UPI ne prend pas en charge d'identifiant ni de source pour un sous-jacent en particulier. Dans ces cas, la valeur affectée par l'initiateur ou le fournisseur de services UPI aux champs « Identifiant du sous-jacent » et « Source de l'identifiant du sous-jacent » ou à leurs attributs équivalents est « AUTRE ». Voici des indications sur les valeurs pouvant être utilisées :

- o **Identifiants de sous-jacent qui ne proviennent pas de la source de référence** : Dans le cas d'un identifiant de sous-jacent ou d'une source d'identifiant de sous-jacent qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de se reporter aux tableaux 9 et 10 de l'Annexe afin de connaître les valeurs autorisées prédéfinies; la liste n'est pas exhaustive et d'autres types pourraient être inclus.
 - o **Identifiants de sous-jacent provenant de la source de référence mais ne figurant pas encore dans la liste d'énumération du fournisseur de services UPI** : Dans le cas d'un identifiant de sous-jacent qui se trouve dans la source de référence mais ne figure pas encore dans la liste d'énumération du fournisseur de services UPI (en raison d'un délai entre la création d'un nouvel identifiant de sous-jacent dans la source de référence et son ajout à la liste en question), la valeur autorisée devrait être celle qui paraît dans la source de référence.
- Les éléments de données 130 et 131 sont nécessaires à la détermination du prix d'un actif ou indice sous-jacent qui ne peut être dérivé de l'UPI.
 - L'élément de données 121 sert à faciliter le repérage des transactions sur dérivés fondées sur des cryptoactifs lorsqu'il n'est pas possible de le faire d'après l'UPI.

1.2.7 Champs relatifs aux autres paiements

Les éléments de données de la série qui concerne les autres paiements peuvent être déclarés plusieurs fois dans le cas de multiples paiements. Si les autres paiements sont faits par versements, il convient de déclarer le calendrier des paiements dans son intégralité.

1.2.8 Paquets de dérivés

Lorsqu'un paquet de dérivés est constitué d'une combinaison de contrats dérivés négociés ensemble en tant que produit d'une seule entente économique et que le tableau des champs ne permet pas de fournir tous les renseignements dans une seule déclaration, la contrepartie déclarante ou l'entité chargée de la déclaration se sert de l'identifiant de paquet de dérivés comme unique lien entre les déclarations relatives à un même contrat dérivé.

Si un dérivé cesse d'exister, mais donne naissance à un autre dérivé, ces deux contrats sont à déclarer individuellement et non comme un paquet de dérivés. Il ne convient donc pas de lier leurs déclarations au moyen d'un identifiant de paquet de dérivés, mais il faut utiliser le champ « UTI antérieur ».

Les champs de déclaration « Prix du paquet de dérivés » et « Monnaie du prix du paquet de dérivés » doivent contenir le prix et la monnaie qui s'applique au paquet de dérivés dans sa totalité et non ceux de ses composants. Si les composants ont des prix individuels, il faut inscrire ces prix et leur monnaie dans les champs « Prix » et « Monnaie du prix » des déclarations pertinentes en plus d'utiliser le « Prix du paquet de dérivés ».

1.2.9 Déclaration des positions

La déclaration des positions est une méthode facultative de déclaration des dérivés qui est conforme aux obligations énoncées à l'article 33.1 des règlements sur la déclaration des opérations. La manière de déclarer les événements du cycle de vie en lien avec certains éléments de données est précisée sous la rubrique 2.1, « Lignes directrices pour la déclaration des positions ». La déclaration des événements du cycle de vie au niveau des positions est possible pour tous les éléments de données pertinents lorsque le dérivé répond aux conditions énoncées. Pour un exemple, voir la rubrique 4.5.

La déclaration des positions n'est possible que si les dérivés ont d'abord été déclarés séparément au niveau des transactions. L'état des dérivés doit être mis à jour au niveau des transactions de manière à ce qu'il soit évident que les dérivés ne sont plus ouverts et ainsi prévenir la double déclaration des dérivés inclus dans les positions. La contrepartie déclarante doit déclarer au niveau des transactions la fin de tout dérivé qui entre dans une position. Pour les nouveaux dérivés inclus dans la position le même jour, elle utilise le type d'action « POSC » sans type d'événement. Pour les dérivés inclus dans la position un autre jour, elle utilise le type d'action « TERM » et le type d'événement « INCP ».

Lorsque la valorisation d'une position devient nulle, il n'y a que deux façons possibles de procéder :

- Mettre fin à la position et déclarer ultérieurement une nouvelle position au moyen d'un UTI différent. Ne déclarer aucune valorisation entre la fin de la première position et la création de la nouvelle.
- Garder la position ouverte et déclarer quotidiennement une valeur nulle.

1.2.10 UTI antérieur

L'UTI antérieur doit être attribué au dérivé qui est le prédécesseur de celui auquel il a donné naissance en raison d'un événement du cycle de vie, lorsque la relation entre les dérivés est d'un à un. Cet élément de données ne s'utilise pas lorsque la relation entre les dérivés est de plusieurs à un ou de plusieurs à plusieurs (par exemple dans le cas d'une compression). Il s'utilise particulièrement à l'occasion des événements suivants :

- Novation complète ou partielle (déclaration avec le type d'action « NEWT » et le type d'événement « NOVA », inclusion de l'UTI antérieur);
- Compensation;
- Exercice (dans le cas des swaptions);
- Répartition (déclaration avec le type d'action « NEWT » et le type d'événement « ALOC », inclusion de l'UTI antérieur).

1.3 Dérivés préalablement existants

Les contreparties ne doivent pas créer de nouveaux UTI pour les dérivés en cours, même si l'UTI d'origine n'est pas entièrement conforme, par exemple, avec les nouveaux formats prescrits par le *Manuel technique*. Dans le cas des IUS (identifiants uniques de swap) utilisés pour des dérivés existants, le référentiel central peut permettre que ces IUS soient transmis comme éléments de données distincts.

Tous les dérivés existants devront ultimement être mis à niveau en fonction des nouvelles exigences et déclarés au moyen du type d'action « Modifier » (MODI) et du type d'événement « Mise à niveau » (UPDT).

2 Spécifications techniques

Éléments de données relatifs aux contreparties

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
1	CDE	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Identifiant de la contrepartie déclarante	L'identifiant de la contrepartie à une transaction sur dérivé de gré à gré⁴ qui remplit son obligation de déclaration par la déclaration en question. Dans les territoires où les deux parties doivent déclarer la transaction, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie toujours la contrepartie déclarante. Dans le cas d'une transaction sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie. Ce gestionnaire peut toutefois être déclaré en tant que contrepartie si l'attribution à des fonds particuliers n'a pas eu lieu avant la date limite de déclaration. Lorsque l'obligation de déclaration est acquittée par une plateforme de négociation, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie l'une des contreparties à la transaction.	Char(20) pour un code LEI	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
2	CDE	Contrepartie 2 (contrepartie non déclarante)	Identifiant de la contrepartie non déclarante	L'identifiant de la deuxième contrepartie⁵ à une transaction sur dérivé de gré à gré. Dans le cas d'une transaction sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie. Ce gestionnaire peut toutefois être déclaré en tant que contrepartie si l'attribution à des fonds particuliers n'a pas eu lieu avant la date limite de déclaration.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O

⁴ Dans les explications des éléments de données du CDE et les annexes du *Manuel technique*, les expressions « dérivé de gré à gré » et « opération » s'entendent d'un dérivé.

⁵ On ne doit déclarer qu'une seule contrepartie. Si plusieurs contreparties se partagent la responsabilité en droit incombant à la seconde contrepartie (par exemple, sont responsables solidairement), ne déclarer qu'une seule de ces contreparties et toujours utiliser cette même contrepartie pour la déclaration des données de continuité et des événements du cycle de vie.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
3	CDE	Source de l'identifiant de la contrepartie 2	Type d'identifiant de la contrepartie 2.	La source servant à identifier la contrepartie 2.	Char(4)	• LEID = identifiant pour les entités juridiques • NPID = identifiant de personne physique, pour identifier les personnes qui agissent en tant que particuliers (non admissible à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale)). • PLID = un identifiant interne seulement si : 1) la contrepartie 2 est soumise à une loi de blocage ou à une exigence de consentement; 2) l'autorité de réglementation compétente membre des ACVM a rendu une décision de dispense relativement aux lois de blocage et exigences de consentement; et 3) la contrepartie déclarante est en conformité avec les conditions de la décision de dispense.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
4	CDE	Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur.	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}. Lorsqu'ils sont utilisés : - la valeur doit correspondre à la valeur soit de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)], soit de [Contrepartie 2] - la valeur ne doit pas correspondre à la valeur de [Identifiant du vendeur]. Sûretés – NR Valorisation – NR
5	CDE	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur.	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un identifiant interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie	N	Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}. Lorsqu'ils sont utilisés : - la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou de [Contrepartie 2] - la valeur ne doit pas correspondre à la valeur de [Identifiant de l'acheteur].

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.		déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.		Sûretés – NR Valorisation – NR
6	CDE	Identifiant du payeur [Identifiant du payeur – branche 1] [Identifiant du payeur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur.	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un identifiant interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration.	N	Transaction – C si [Identifiant de l'acheteur] et [Identifiant du vendeur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}. Lorsqu'ils sont utilisés, la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou de [Contrepartie 2]. Sûretés – NR Valorisation – NR
7	CDE	Identifiant du receveur [Identifiant du receveur – branche 1] [Identifiant du receveur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse.	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration.	N	Transaction – C si [Identifiant de l'acheteur] et [Identifiant du vendeur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}. Lorsqu'ils sont utilisés, la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou de [Contrepartie 2]. Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
8	ESMA	Identifiant du courtier ⁶	Identifiant d'un courtier qui agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie.	Lorsque le courtier agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie, la contrepartie 1 doit désigner ce courtier par un identifiant pour les entités juridiques.	Char(20)	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
9	ACVM	Pays et province ou territoire de la personne physique (contrepartie non déclarante)	Si la personne physique est une contrepartie non déclarante, le pays de résidence de celle-ci et, si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	Si la contrepartie non déclarante est une personne physique, le pays de résidence de celle-ci et, si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	Varchar(5)	Toute valeur valide selon la norme ISO 3166-2 si la résidence de la personne physique est au Canada; sinon, utiliser la norme ISO 3166 pour le pays de résidence de la personne physique.	N	Transaction – C si [Source de l'identifiant de la contrepartie 2] = NPID, sinon (facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
10	ACVM	Territoire de la contrepartie 1	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 1 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, uniquement si la contrepartie non déclarante est une personne physique résidant dans le territoire en question, et/ou - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> (chapitre I-14.01, r. 1.1) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (chapitre I-14.01)⁷.	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 1 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, si la contrepartie non déclarante est une personne physique résidant dans le territoire en question, et/ou - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> (chapitre I-14.01, r. 1.1) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (chapitre I-14.01)⁷.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O

⁶ En anglais, le nom de cet élément de données selon l'ESMA est « Broker ID » (au lieu de « Broker identifier » selon le *Manuel technique*).

⁷ Une liste des personnes agréées se trouve à l'adresse <https://autorite.qc.ca/professionnels/valeurs-mobilières-et-dérivés/encadrement-des-marchés-des-dérivés-au-québec>.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
			déclaration de données sur les dérivés (chapitre I-14.01, r. 1.1) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi sur les instruments dérivés (chapitre I-14.01).					
11	ACVM	Territoire de la contrepartie 2	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 2 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi sur les instruments dérivés.	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 2 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, et/ou - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la Loi sur les instruments dérivés.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O

Éléments de données relatifs aux dérivés

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
12	CDE	Date d'entrée en vigueur ⁸	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé entrent en vigueur.	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré entrent en vigueur. Liste non exhaustive d'exemples : Pour les swaps sur défaillance sur un indice de crédit, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat (soit habituellement un jour ou deux après la date d'exécution), et non la date de report de position de l'indice sous-jacent. Pour les contrats de garantie de taux, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat, et non la date de règlement. Pour les options et les swaptions, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat, et non celle du sous-jacent. Pour les swaps de taux d'intérêt différés, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat (appelée date de début différée dans le contrat). Pour les contrats dont la confirmation n'inclut pas de date d'entrée en vigueur, s'ils sont déclarés, la date d'entrée en vigueur qui débute immédiatement devrait être celle qui figure dans la partie « date » de l'horodatage de l'exécution. Pour les nouveaux contrats découlant d'événements du cycle de vie, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du nouveau contrat.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
13	CDE	Date d'expiration ⁹	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé cessent d'avoir effet.	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré cessent d'avoir effet. Cet élément n'est pas modifié s'il est mis fin à la transaction par anticipation.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – C si l'UPI [Retour ou paiement] n'est pas un contrat sur différence (CFD), sinon (facultatif). Lorsque cet élément est utilisé, la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Date d'entrée en vigueur] ou à la partie « date » de [Horodatage de l'exécution]. Sûretés – NR

⁸ Pour les swaps de marchandises, déclarer la date de début des prix.⁹ Pour les swaps de marchandises, déclarer la date de fin des prix.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Valorisation – NR
14	CDE	Horodatage de l'exécution	La date et l'heure de l'exécution de la transaction.	La date et l'heure de l'exécution initiale de la transaction ayant généré un nouvel UTI. Cet élément demeure inchangé pendant la durée de validité de l'UTI ¹⁰ .	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC ¹¹ . Si l'élément temporel n'est pas requis dans une province, un territoire ou un État en particulier, l'heure peut être omise étant donné que, dans le cas de représentations à précision réduite, la norme ISO 8601 permet d'omettre des éléments de la représentation de la date/heure, l'omission commençant par l'extrême droite (dans l'ordre, à partir de l'élément le moins significatif).	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
15	CDE	Horodatage de la déclaration ¹²	La date et l'heure de soumission de la déclaration au référentiel central.	La date et l'heure auxquelles la déclaration est effectivement transmise au référentiel central.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – O; la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Horodatage de l'exécution] Sûretés – O Valorisation – O
16	CDE	Identifiant unique de transaction (UTI)	L'identifiant unique qui identifie un dérivé ou une position pendant tout son cycle de vie.	L'identifiant unique attribué à la transaction ou à la position qui sert à les identifier de manière unique pendant tout leur cycle de vie dans l'ensemble des dossiers et déclarations.	Varchar(52)	Identifiant unique de transaction ISO 23897, jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Les nouveaux UTI doivent être construits uniquement à partir des lettres majuscules de A à Z ou des chiffres de 0 à 9 inclusivement. L'UTI est constitué du LEI de l'entité qui le crée et d'un code alphanumérique unique.	N	Transaction – O Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] = « TRANSACTION-LEVEL », sinon {champ vide} Valorisation – O

¹⁰ Pour les dérivés compensés, l'horodatage de l'exécution est la date et l'heure auxquelles la chambre de compensation accepte le dérivé d'origine pour compensation.

¹¹ La déclaration doit inclure la partie date et la partie heure.

¹² L'horodatage de la déclaration (#15) est exécuté et déclaré par l'initiateur.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
17	CDE	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'UTI attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	L'UTI attribué à la transaction antérieure ayant donné lieu à la transaction déclarée en raison d'un événement du cycle de vie dans une relation entre les transactions qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'une transaction est résiliée et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou lorsqu'une transaction est scindée en plusieurs différentes). Cet élément de données ne s'applique pas lors de la déclaration de relations de plusieurs à une et de plusieurs à plusieurs entre des transactions (par exemple, dans le cas d'une compression).	Varchar(52)	Identifiant unique de transaction ISO 23897, jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Les nouveaux UTI doivent être construits uniquement à partir des lettres majuscules de A à Z ou des chiffres de 0 à 9, inclusivement.	N	Transaction – C si [Type d'action] = « NEWT » et si ([Type d'événement] = « NOVA » ou « CLRG » ou « EXER » ou « ALOC » ou « CLAL ») et si [USI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
18	ESMA	UTI de la position subséquente	L'UTI de la position dans laquelle le dérivé est inclus.	L'UTI de la position dans laquelle le dérivé est inclus. Ce champ ne s'applique qu'aux déclarations relatives à la fin d'une transaction sur dérivé du fait de son inclusion dans une position.	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Seuls les lettres majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés.	Lettres majuscules A-Z et chiffres 0-9 autorisés	N	Transaction – C si ([Type d'action] = « POSC ») ou ([Type d'action] = « TERM » et [Type d'événement] = « INCP »), sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
19	CFTC	USI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'identifiant unique de swap (USI) attribué au dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	L'identifiant unique de swap (USI) attribué à la transaction antérieure ayant donné lieu à la transaction déclarée en raison d'un événement du cycle de vie, dans une relation entre les transactions qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'il est mis fin à une transaction et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou lorsqu'une transaction est scindée en plusieurs différentes). Cet élément de données ne s'applique pas lors de la déclaration de relations de plusieurs à une et de plusieurs à plusieurs entre des transactions (par exemple, dans le cas d'une compression).	Varchar(42)	Se reporter à : CFTC USI Data Standard Jusqu'à 42 caractères alphanumériques	N	Transaction – C si [Type d'action] = « NEWT » et si ([Type d'événement] = « NOVA » ou « CLRG » ou « EXER » ou « ALOC » ou « CLAL ») et si [UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
20	ACVM	Indicateur intragroupe	L'indication que le dérivé est conclu ou non entre deux entités du même groupe.	Indique si le dérivé est conclu entre deux entités du même groupe.	Booléen	•Vrai = contrat conclu dans le cadre d'une transaction intragroupe •Faux = contrat non conclu dans le cadre d'une transaction intragroupe	N	Transaction – C si [Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme] = « Faux » et [Compensé] = « N », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
21	CDE	Identifiant de l'initiateur	L'identifiant de l'entité soumettant les données sur les dérivés au référentiel central.	L'identifiant de l'entité transmettant la transaction sur dérivé de gré à gré au référentiel central. En cas de recours à un tiers fournisseur de services pour la transmission des données au référentiel central, il convient de déclarer l'identifiant de ce tiers.	Char(20)	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
22	CDE	Identifiant de la plateforme	L'identifiant de la plateforme de négociation sur laquelle la transaction a été exécutée.	L'identifiant de la plateforme de négociation (par exemple, une bourse, une plateforme de négociation multilatérale, une plateforme d'exécution de swaps) sur laquelle la transaction a été exécutée.	Char(4)	Code d'identification de marché (MIC) de segment ISO 10383 ¹³ . Si aucun système de négociation n'a été utilisé pour la transaction : • XOFF pour les transactions portant sur des instruments cotés; • XXXX pour les transactions portant sur des instruments non cotés; • BILT si la contrepartie déclarante n'est pas en mesure de déterminer d'après les obligations imposées par les autorités compétentes si l'instrument est coté ou non.	O	Transaction – C si [Compensé] = « N » ou « I », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
23	ACVM	Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme	L'indication que la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme de négociation.	Indique si la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme de négociation.	Booléen	• Vrai = la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme • Faux = la transaction n'a pas été exécutée anonymement sur une plateforme ou sans objet	N	Transaction – O ¹⁴ Sûretés – NR Valorisation – NR
24	ESMA	Type d'accord-cadre	Type d'accord-cadre.	Mention du type d'accord-cadre selon lequel les contreparties ont conclu un dérivé.	Char(4)	• « ISDA » – ISDA • « CDEA » – Accord d'exécution de produits dérivés compensés FIA-ISDA • « EUMA » – Accord-cadre européen • « FPCA » – Accord de clientèle professionnelle de la FOA • « FMAT » – Accord-cadre de la FBF concernant des transactions portant sur des instruments financiers pour contrat à terme de gré à gré • « DERV » – Accord-cadre allemand concernant les transactions portant sur des instruments financiers pour contrat à terme de gré à gré (DRV) • « CMOP » – Accord-cadre pour les transactions financières • « CHMA » – Accord-cadre suisse • « IDMA » – Accord-cadre sur les produits dérivés islamiques	N	Transaction – C si [Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme] = Faux, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

¹³ S'il n'existe pas de MIC de segment, utiliser le MIC d'exploitation.

¹⁴ L'élément de données 23 est obligatoire pour les transactions exécutées sur une plateforme de négociation.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
						• « EFMA » – Accord-cadre de l'EFET • « GMRA » – Accord-cadre mondial de rachat • « GMSL » – Accord-cadre mondial de prêt de valeurs mobilières • « BIAG » – Accord bilatéral • Ou « OTHR » pour les swaps compensés ou toute autre transaction sur dérivé qui n'est pas couverte par un type d'accord-cadre ou pour laquelle l'accord-cadre applicable ne figure pas dans la liste précédente.		
25	ESMA	Version de l'accord-cadre	Année de la version de l'accord-cadre.	Mention de l'année de l'accord-cadre (p. ex. 1992, 2002) s'appliquant, le cas échéant, au dérivé déclaré.	AAAA	Date ISO 8601 en format AAAA	N	Transaction – C si [Type d'accord-cadre] ≠ « BIAG » ou null, sinon (facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux montants et quantités notionnels

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
26	CDE	Montant notionnel ¹⁵ [montant notionnel – branche 1] [montant notionnel – branche 2]	Montant notionnel à l'égard de chaque branche d'un dérivé : • si le dérivé est négocié en montant monétaire, le montant qui y est stipulé; • si le dérivé est négocié en montant non monétaire, le convertir en montant monétaire.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : - pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires, le montant stipulé dans le contrat; - pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires, se reporter à l'annexe 3.1 pour la conversion des montants notionnels en des montants non monétaires. • Pour les transactions sur dérivés de gré à gré prévoyant un tableau de montants notionnels, le montant déclaré sous cet élément de données est le montant notionnel initial convenu par les contreparties au début de la transaction; • pour les options sur devises de gré à gré, outre cet élément de données, les montants sont déclarés au moyen des éléments de données Montant d'achat et Montant de vente; • pour les modifications ou les événements du cycle de vie¹⁶, on déclare le montant notionnel en cours qui en résulte (les réalisations des étapes des tableaux des montants notionnels ne sont pas considérées comme des modifications ou des événements	Num(25,5)	Toute valeur (les valeurs négatives ne sont permises que lorsqu'elles s'appliquent à un dérivé sur marchandises, p. ex. pour la prise en compte du coût de stockage) ¹⁷ .	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR

¹⁵ Pour les swaps sur défaillance de crédit, il s'agit du montant brut et non du montant net après incrément de version dû à un événement de crédit.

¹⁶ Si l'événement du cycle de vie est une résiliation complète avant la date d'échéance, la pleine valeur résiliée est à déclarer dans l'élément de données Montant notionnel.

¹⁷ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « 99999999999999999999,9999 » (25 caractères numériques, décimales comprises).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				du cycle de vie); • si le montant notionnel est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu.				
27	CDE	Monnaie notionnelle [monnaie notionnelle – branche 1] [monnaie notionnelle – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, la monnaie dans laquelle le montant notionnel est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	O	Transaction – [Monnaie notionnelle – branche 1] C si [Monnaie notionnelle – branche 1] est utilisé, sinon {facultatif} [Monnaie notionnelle – branche 2] C si [Monnaie notionnelle – branche 2] est utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
28	CDE	Montant d'achat	Montant monétaire qu'une personne a le droit d'acheter en vertu d'une option.	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure à zéro.	N	Transaction – FX – C si UPI. [Type d'instrument] = « Option » et UPI. [Produit] ≠ « Option numérique », au moins un de ces éléments est requis : ([Montant d'achat] ou [Montant de vente]), sinon {facultatif} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
29	CDE	Monnaie d'achat	Monnaie du montant d'achat d'une option.	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant d'achat est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – FX – C si [Montant d'achat] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
30	CDE	Montant de vente	Montant monétaire qu'une personne a le droit de vendre en vertu d'une option.	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit de vendre.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure à zéro.	N	Transaction – FX – C si UPI. [Type d'instrument] = « Option » et UPI. [Produit] ≠ « Option numérique », au moins un de ces éléments est requis : ([Montant d'achat] ou [Montant de vente]), sinon {facultatif} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
31	CDE	Monnaie de vente	Monnaie du montant de vente d'une option.	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant de vente est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – FX – C si [Montant de vente] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
32	CFTC	Quantité notionnelle [quantité notionnelle – branche 1] [quantité notionnelle – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé négocié en montant non monétaire, la quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau.	À l'égard de chaque branche d'une transaction de swap ¹⁸ , s'il y a lieu, relativement aux transactions de swap négociées en montants non monétaires, quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau (par exemple, 50 barils par mois). La fréquence est déclarée dans la Fréquence de cotation de la quantité, et l'unité de mesure l'est dans l'Unité de mesure de la quantité.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO – F Lorsque le champ est utilisé, la valeur doit être inférieure ou égale à la valeur du champ [Quantité notionnelle totale]. Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
33	CFTC	Fréquence de cotation de la quantité ¹⁹ [fréquence de cotation de la quantité – branche 1] [fréquence de cotation de la quantité –	Période pour laquelle la quantité est cotée.	À l'égard de chaque branche d'une transaction de swap, s'il y a lieu, la cadence à laquelle la quantité est cotée à l'égard de la transaction (par exemple aux heures, quotidiennement, hebdomadairement ou mensuellement).	Char(4)	• HOUL = Horaire • DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • ONDE = Sur demande • YEAR = Annuelle • EXPI = Fin du contrat • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers)	N	Transaction – CO [Fréquence de cotation de la quantité – branche 1] – C si [Quantité notionnelle – branche 1] est utilisé, sinon {champ vide} [Fréquence de cotation de la quantité – branche 2] – C si

¹⁸ Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « swap » et « opération de swap » s'entendent d'un dérivé.

¹⁹ Pour représenter une fréquence trimestrielle, déclarer [Fréquence de cotation de la quantité] = « MNTH » et [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur] = « 3 ». Pour une fréquence semestrielle, déclarer [Fréquence de cotation de la quantité] = « MNTH » et [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur] = « 6 ».

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
		branche 2]						[Quantité notionnelle – branche 2] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
34	CFTC	Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur [fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 1] [fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 2]	Nombre de périodes de fréquence de cotation de la quantité.	À l'égard de chaque branche de la transaction de swap, s'il y a lieu, le nombre d'unités de temps de la fréquence de cotation de la quantité.	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 1] – C si [Fréquence de cotation de la quantité – branche 1] ≠ « ONDE » ou « ADHO », sinon {facultatif} [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 2] – C si [Fréquence de cotation de la quantité – branche 2] ≠ « ONDE » ou « ADHO », sinon {facultatif} Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
35	CDE	Unité de mesure de la quantité [unité de mesure de la quantité – branche 1] [unité de mesure de la quantité – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de mesure de la quantité notionnelle totale et de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : l'unité de mesure dans laquelle la Quantité notionnelle totale et la Quantité notionnelle sont exprimées.	Varchar(4)	Jeu de codes d'unités de mesure ISO 20022 ou autre jeu de codes d'UDM approuvé pour la DD	N	Transaction – EQ/CO – O Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
36	CDE	Quantité notionnelle totale [quantité notionnelle totale – branche 1] [quantité notionnelle totale – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la quantité notionnelle globale de l'élément sous-jacent pendant la durée du dérivé.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la Quantité notionnelle globale de l'actif sous-jacent pendant la durée de la transaction. Lorsque la Quantité notionnelle totale est inconnue au moment de la déclaration de la nouvelle transaction, elle doit être mise à jour dès qu'elle est connue.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro ²⁰ .	N	Transaction – EQ/CO – O Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
37	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée [date de prise d'effet de la quantité notionnelle – branche 1] [date de prise d'effet de la quantité notionnelle – branche 2]	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau : - la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants non monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : La date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée Montant notionnel initial – date de prise d'effet déclarée en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CO – C si [Tableau de quantités notionnelles – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon {champ vide} Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de quantité notionnelle. Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
38	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – date de fin non ajustée de la quantité notionnelle [date de fin de la quantité notionnelle – branche 1] [date de fin de la quantité notionnelle – branche 2]	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau : - la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : La date de fin non ajustée de la quantité notionnelle (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date d'effet non ajustée de la période subséquente) La date de fin figurant au tableau de la quantité notionnelle initiale est déclarée en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CO – F Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de quantité notionnelle si ce champ est utilisé. Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁰ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « 99999999999999999999 » (25 caractères numériques, décimales comprises).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
39	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée [quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 1] [quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 2]	Chaque quantité notionnelle, indiquée dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 37 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 38.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : • La quantité notionnelle qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée. La quantité notionnelle figurant au tableau de la quantité notionnelle initiale est déclarée en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO – F Le nombre de valeurs de quantité notionnelle doit évaluer le nombre d'intervalles de date. Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
40	CDE	Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée [montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 1] [montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 2]	Chaque montant notionnel, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 41 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 42.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : Le montant notionnel qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée. Le montant notionnel figurant au tableau du montant notionnel initial est déclaré en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.	Num(25,5)	Toute valeur	N	Transaction – IR – C si UPI.[Tableau des montants notionnels] ≠ « Constant », sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de montant notionnel doit évaluer le nombre d'intervalles entre date de début et date de fin. Transaction – CR/FX/CO/EQ – F Sûretés – NR Valorisation – NR
41	CDE	Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet non ajustée du montant notionnel [date de prise d'effet du montant notionnel – branche 1] [date de prise d'effet du montant notionnel – branche 2]	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau : • la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : La date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend effet. La date de prise d'effet figurant au tableau de montants notionnels est déclarée en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon {champ vide} Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de montant notionnel. Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
42	CDE	Tableau de montants notionnels – date de fin non ajustée du montant notionnel [date de fin du montant notionnel – branche 1] [date de fin du montant notionnel – branche 2]	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau : • la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : La date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date d'effet non ajustée de la période subséquente). La date de fin figurant au tableau de montants notionnels est déclarée en tant que première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – F Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de montant notionnel si le champ est utilisé. Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux prix

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
43	CDE	Taux de change ²¹	Le taux de change des deux monnaies du dérivé.	Le taux de change des deux monnaies de la transaction sur dérivé de gré à gré dont les contreparties ont convenu au début de la transaction, exprimé en taux de conversion de l'unité monétaire en monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. Le taux de change à déclarer est le taux de change à terme.	Num(18,13)	Toute valeur supérieure à zéro.	N	Transaction – FX – C si [UPI, [Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif}] Transaction – IR/FX/CO/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
44	CDE	Base du taux de change	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé.	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé. Cet élément est exprimé en unité monétaire/monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR.	Char(3)/Char(3); [unité monétaire/monnaie cotée], sans restreindre l'ordre de la paire de monnaies (c'est-à-dire que la base du taux de change peut être USD/EUR ou EUR/USD).	Toute paire de monnaies incluse dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – FX – O Transaction – IR/CR/CO/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

²¹ Pour les opérations sur devises, il s'agit du taux de change à terme.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
45	CDE	Taux fixe [taux fixe – branche 1] [taux fixe – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé prévoyant des paiements périodiques, le taux annuel de la branche fixe.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques, le taux annuel de la ou des branches fixes.	Nul (11,10)	Valeurs positives et négatives exprimées en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %)	O	Transaction – CR – C si [Écart] n'est pas utilisé et [Type d'autre paiement] ≠ « UFRO » et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – IR C si [Écart] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – CO C si [Prix] ou [Écart] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – FX/EQ – F Sûretés – NR Valorisation – NR
46	CDE	Prix ²²	Le prix indiqué dans le dérivé.	Le prix spécifié de la transaction sur dérivé de gré à gré, les frais, droits, taxes et commissions étant exclus. Pour les swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et les produits semblables ²³ avec paiements périodiques, cet élément de données renvoie au prix fixe de la ou des branches fixes. Pour les contrats à terme de gré à gré sur marchandises et sur actions et les produits semblables, il renvoie au prix à terme de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les contrats sur différence et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent. Cet élément de données ne s'applique pas dans les cas suivants : • Les swaps de taux d'intérêt et les contrats de garantie de taux de gré à gré, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe et Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur taux d'intérêt et les swaptions sur taux d'intérêt, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction;	• Num(18,13) si la Notation du prix = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix = 3	• N'importe quelle valeur si la Notation du prix = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix = 3	O	Transaction – EQ – C si [Écart] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – CO C si ([Taux fixe] ou [Écart] n'est pas utilisé) et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – IR/FX/CR – F Sûretés – NR Valorisation – NR

²² Le Prix (#46) rend compte du prix auquel les parties ont négocié le contrat, tandis que le prix pratiqué sur le marché est représenté par le montant de la valorisation.

²³ Dans les explications des éléments de données du CDE, « produit » s'entend d'un dérivé.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				• Les swaps de référence sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans l'élément de données Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les swaps, contrats à terme de gré à gré et contrats d'option sur devises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux de change, Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur actions, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les swaps sur défaillance et les swaps sur rendement total de crédit, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe, Écart et Paiement forfaitaire unique (Type d'autre paiement : Paiement forfaitaire unique) peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. Si le prix est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu. Pour les transactions qui font partie d'un paquet, cet élément de données contient le prix de la transaction qui en est une composante, le cas échéant.				
47	CDE	Monnaie du prix	La monnaie dans laquelle le prix est libellé.	La monnaie dans laquelle le prix est libellé. La monnaie du prix ne s'applique que si la Notation du prix = 1.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – C si [Notation du prix] = « 1 », sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
48	CDE	Notation du prix	La manière dont le prix est exprimé.	La manière dont le prix est exprimé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	O	Transaction – C si [Prix] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
49	CDE	Unité de mesure du prix	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	Varchar(4)	Jeu de codes d'unités de mesure ISO 20022 ou autre jeu de codes d'UDM approuvé pour la DD	N	Transaction – C si [Prix] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
50	CDE	Tableau de prix – date de prise d'effet non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • La date de prise d'effet non ajustée du prix. Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de prix – prix] est utilisé, sinon {champ vide} Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de prix. Sûretés – NR Valorisation – NR
51	CDE	Tableau de prix – date de fin non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • la date non ajustée à laquelle le prix prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date de prise d'effet non ajustée de la période subséquente). Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – F Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de prix si le champ est utilisé. Sûretés – NR Valorisation – NR
52	CDE	Tableau de prix – prix	Chaque prix, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 50 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 51.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • Le prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	• Num(18,13) si la Notation du prix = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix = 3	• N'importe quelle valeur supérieure à zéro, si la Notation du prix = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix = 3	N	Transaction – EQ – C si [Prix] ou [Écart] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – CO C si ([Prix], [Taux fixe] ou [Écart] n'est pas utilisé) et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de prix doit évaluer le nombre

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								d'intervalles de date de début. Transaction – CR/IR/FX – F Sûretés – NR Valorisation – NR
53	CDE	Écart ²⁴ [écart – branche 1] [écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'écart précisé sur le prix de référence.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu. Pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques (par exemple, swaps fixe-variable, swaps variable-variable, swaps sur marchandises) : • soit, lorsqu'il existe un écart pour une ou plusieurs branches variables, l'écart sur le prix établi par référence à un indice de la ou des branches variables (par exemple, USD-LIBOR-BBA plus 0,03 ou WTI moins 14,65 USD) • soit la différence entre les prix établis par référence à un indice de chacune des branches variables (par exemple, l'écart de 9,00 USD pour un swap de référence WCS-WTI lorsque le WCS est évalué à 43 USD et le WTI à 52 USD).	• Num(18,13) si la Notation de l'écart = 1 • Num(11,10) si la Notation de l'écart = 3 • Num(5) si la Notation de l'écart = 4	• N'importe quelle valeur si la Notation de l'écart = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart = 3 • N'importe quel nombre entier exprimé en points de base (par exemple, 257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart = 4	O	Transaction – CR – C si [Taux fixe] n'est pas utilisé et [Type d'autre paiement] ≠ « UFRO » et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – IR C si [Taux fixe] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – EQ – C si [Prix] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – CO C si [Prix] ou [Taux fixe] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
54	CDE	Monnaie de l'écart [monnaie de l'écart – branche 1] [monnaie de l'écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie dans laquelle l'écart est libellé.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la monnaie dans laquelle l'écart est libellé. Cet élément de données ne s'applique que si la Notation de l'écart = 1.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – [Monnaie de l'écart – branche 1] C si [Notation de l'écart – branche 1] = « 1 », sinon {champ vide} [Monnaie de l'écart – branche 2] C si [Notation de l'écart – branche 2] = « 1 », sinon {champ vide} Sûretés – NR

²⁴ Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les contrats sur différence, déclarer l'écart moyen pondéré pour le panier et non pour chacune des branches.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Valorisation – NR
55	CDE	Notation de l'écart [notation de l'écart – branche 1] [notation de l'écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la manière dont est exprimé l'écart.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la manière dont est exprimé l'écart.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales • 4 = Points de base	O	Transaction – [Notation de l'écart – branche 1] C si [Écart – branche 1] est utilisé, sinon {champ vide} [Notation de l'écart – branche 2] C si [Écart – branche 2] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
56	CDE	Prix d'exercice	Pour le dérivé qui est une option, le prix auquel son titulaire peut acheter ou vendre l'élément sous-jacent.	• Pour les options autres que celles sur devises²⁵, les swaptions et les produits semblables, le prix auquel le titulaire de l'option peut acheter ou vendre l'actif sous-jacent. • Pour les options sur devises, le taux de change auquel l'option peut être exercée, exprimé en taux de conversion de l'unité monétaire en monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. Si le prix d'exercice est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu; • Pour les swaps de volatilité et de variance et les produits semblables, la volatilité/variance d'exercice.	• Num(18,13) si la Notation du prix d'exercice = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 3	• Toute valeur (par exemple, 6,39 USD exprimée sous la forme 6,39), pour les options sur actions, les options sur marchandises, les options sur devises et les produits semblables, si la Notation du prix d'exercice = 1. • Toute valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,021 au lieu de 2,1 %) pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart, et les produits semblables, si la Notation du prix d'exercice = 3.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
57	CDE	Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies	Monnaie ou la paire et l'ordre des monnaies dans lesquels le prix d'exercice est libellé.	Pour les options sur actions, les options sur marchandises et les produits semblables, la monnaie dans laquelle le prix d'exercice est libellé. Pour les options sur devises : la paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le prix d'exercice est libellé. Le prix d'exercice s'exprime en unité monétaire/monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. L'élément Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies ne s'applique que si la Notation du prix d'exercice = 1.	• Char(3) • Pour les options sur devises : Char(3)/Char(3); [unité monétaire/monnaie cotée] sans restreindre l'ordre de la paire de monnaies (c'est-à-dire que la paire de monnaies du prix d'exercice peut être USD/EUR ou EUR/USD).	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix d'exercice] = « 1 », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁵ Dans le texte anglais des explications des éléments de données du CDE, « FX » s'entend des devises et du change.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
58	CDE	Notation du prix d'exercice	Manière dont le prix d'exercice est exprimé.	La manière dont le prix d'exercice est exprimé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	O	Transaction – C si [Prix d'exercice] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
59	CDE	Date de prise d'effet non ajustée du prix	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 50]
60	CDE	Date de fin non ajustée du prix	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 51]
61	CDE	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée	Prix en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 59 et celle stipulée dans l'élément de données 60.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 52]
62	CDE	Date de prise d'effet du prix d'exercice	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 65]

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
63	CDE	Date de fin du prix d'exercice	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 66]
64	CDE	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Prix d'exercice en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 62 et celle stipulée dans l'élément de données 63.	[Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	[Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	N	[Sans objet : doublon de l'élément de données 67]
65	CDE	Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : La date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice. Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice] est utilisé, sinon {champ vide} Le nombre de valeurs de date doit égaler le nombre de valeurs de prix d'exercice. Sûretés – NR Valorisation – NR
66	CDE	Tableau de prix d'exercice – date de fin non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : La date non ajustée à laquelle le prix prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date de prise d'effet non ajustée de la période subséquente). Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – F Le nombre de valeurs de date doit égaler le nombre de valeurs de prix d'exercice si le champ est utilisé. Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
67	CDE	Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice	Chaque prix d'exercice, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 65 et celle stipulée dans l'élément de données 66.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : Le prix d'exercice en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	- Num(18,13) si la Notation du prix d'exercice = 1 - Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 3	- Pour les options sur actions, les options sur marchandises, les options sur devises et les produits semblables, toute valeur (par exemple, 6,39 USD exprimée sous la forme 6,39), si la Notation du prix d'exercice = 1; - Pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart et les produits semblables, toute valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,021 au lieu de 2,1 %), si la Notation du prix d'exercice = 3.	N	Transaction – C si [Prix d'exercice] n'est pas utilisé et UPL.[Type d'instrument] = « Option », sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de prix d'exercice doit évaluer le nombre d'intervalles de dates de début. Sûretés – NR Valorisation – NR
68	CFTC	Indicateur de modalités non normalisées	Indication que le dérivé comporte ou non au moins une disposition qui influe considérablement sur son prix, et qui n'a pas été diffusée dans le public.	Indique si la transaction de swap comporte au moins une modalité ou disposition, outre celles diffusées dans le public suivant la partie 43 ²⁶ , qui influe considérablement sur son prix.	Booléen	- Vrai - Faux	O	Transaction – C si [Compensé] = « N », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
69	CDE	Convention de calcul des jours [convention de calcul des jours à taux fixe – branche 1] [convention de calcul des jours à taux fixe – branche 2] [convention de calcul des jours à taux variable – branche 1] [convention de calcul des jours à taux variable – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la convention de calcul des jours utilisée pour établir le mode de calcul des paiements d'intérêts.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la convention de calcul des jours (souvent aussi appelée fraction de compte de jours, base de décompte des jours ou méthode de décompte des jours) qui établit le mode de calcul des paiements d'intérêts. Cet élément sert à déterminer la fraction représentée par la période de calcul dans l'année et correspond au nombre de jours compris dans cette période divisé par le nombre de jours dans l'année. Voir l'annexe 3.2 pour les définitions des valeurs.	Char(4)	- A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule - A002 = IC30365 - A003 = IC30Actual - A004 = Actual360 - A005 = Actual365Fixed - A006 = ActualActualCMA - A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 - A008 = ActualActualSDA - A009 = Actual365LorActuActubasisRule - A010 = ActualActualAFB - A011 = IC30360ICMAor30360basicrule - A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 - A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 - A014 = Actual365NL - A015 = ActualActualUltimo - A016 = IC30EPlus360 - A017 = Actual364 - A018 = Business252 - A019 = Actual360NL - A020 = 1/1 - NARR = Narrative	O	Transaction – [Convention de calcul des jours à taux fixe – branche 1] F si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 1] est utilisé, sinon {champ vide} [Convention de calcul des jours à taux fixe – branche 2] F si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 2] est utilisé, sinon {champ vide} [Convention de calcul des jours à taux variable – branche 1] CO/EQ C si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 1] est utilisé, sinon {facultatif} CR/IR/FX – F [Convention de calcul des jours à taux variable –

²⁶ La contrepartie déclarante peut déclarer l'élément de données d'une manière qui reflète la diffusion publique suivant les exigences d'une quelconque autorité de réglementation (par exemple, la partie 43 de la CFTC ou les règlements sur la déclaration des opérations).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								branche 2] CO/EQ C si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 2] est utilisé, sinon {facultatif} CR/IR/FX – F Sûretés – NR Valorisation – NR
70	CFTC	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps [fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] [fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2]	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, l'unité de temps qui détermine la fréquence des révisions.	Pour chaque branche variable de la transaction de swap, s'il y a lieu, l'unité de temps associée à la fréquence des révisions (par exemple, jour, mois, année ou durée du flux).	Char(4)	• DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • YEAR = Annuelle • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers) • EXPI = Paiement à l'échéance	O	Transaction – [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] IR C si UPI.[Type d'instrument] = « Swap » et UPI.[Type d'actif sous-jacent] ≠ « Fixe - fixe » et [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] est NULL, sinon {facultatif} [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] IR C si UPI.[Type d'instrument] = « Swap » et UPI.[Type d'actif sous-jacent] ≠ « Fixe - fixe » et [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] est NULL, sinon {facultatif} Transaction – CR/FX/EQ/CO – F Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
71	CFTC	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur [fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 1] [fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 2]	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, le nombre par lequel est multipliée l'unité de temps de la fréquence de révision du taux variable afin de déterminer la fréquence des dates de révision du taux des paiements périodiques.	À l'égard de chaque branche variable de la transaction de swap, s'il y a lieu, le nombre d'unités de temps (indiqué par la Fréquence de révision du taux variable – unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates de révision du taux des paiements périodiques surviennent. Par exemple, une transaction dont les paiements révisables ont lieu tous les deux mois est représentée par une fréquence de révision du taux variable de « MNTH » (mensuelle) et une fréquence de révision du taux variable – multiplicateur de « 2 ». Cet élément de données ne s'applique pas si la fréquence de révision du taux variable est « ADHO ». Si elle est « EXPI », la fréquence de révision du taux variable – multiplicateur est « 1 ». Si elle est intrajournalière, la fréquence de révision du taux variable est « DAIL » et la fréquence de révision du taux variable – multiplicateur est « 0 ».	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	0	Transaction – [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 1] C si [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] est utilisé et ≠ « ADHO », sinon {champ vide} [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 2] C si [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] est utilisé et ≠ « ADHO », sinon {champ vide} Lorsque [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] contient la valeur « EXPI », [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – multiplicateur – branche 1] doit être « 1 » Lorsque [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] contient la valeur « EXPI », [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – multiplicateur – branche 2] doit être « 1 » Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs à la compensation

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
72	CDE	Compensé	Indique si un dérivé a été ou sera compensé par une chambre de compensation.	Indique si la transaction a été ou sera compensée par une contrepartie centrale. ²⁷	Char(1)	• Y = Oui, compensé par une contrepartie centrale, pour les transactions de types bêta et gamma. • N = Non, pas compensé par une contrepartie centrale. • I = Compensation prévue, pour les transactions de type alpha qu'il est prévu de soumettre aux fins de compensation.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
73	CDE	Identifiant de la contrepartie centrale	Identifie la chambre de compensation qui a compensé le dérivé.	L'identifiant de la contrepartie centrale qui a compensé la transaction. Cet élément de données ne s'applique pas si la valeur de l'élément de données « Compensé » est « N » (non compensé par une contrepartie centrale) ou « I » (compensation prévue).	Char(20)	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – C si [Compensé] = « Y », sinon {facultatif} Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit correspondre à celle de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)]. Sûretés – NR Valorisation – NR
74	CFTC	Origine du compte de compensation	Indique si le membre compensateur agit comme contrepartiste ou mandataire.	Indique si un membre compensateur a agi comme contrepartiste pour une chambre de compensation ou comme mandataire pour un client.	Char(4)	• HOUS = Chambre de compensation • CLIE = Client	N	Transaction – C si Compensé = « Y », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
75	CDE	Identifiant du membre compensateur	Identifie le membre compensateur qui fait compenser le dérivé auprès d'une chambre de compensation.	L'identifiant du membre compensateur par l'entremise duquel la transaction sur dérivé a été compensée auprès d'une contrepartie centrale. Cet élément de données s'applique aux transactions compensées dans le cadre du modèle de la transaction pour compte de tiers et du modèle de la transaction de contrepartie ²⁸ . • Dans le cas du modèle de la transaction de contrepartie, le membre compensateur est identifié en tant que membre compensateur et également en tant que contrepartie dans les deux transactions résultant de la compensation : i) dans la transaction entre la contrepartie centrale et le membre compensateur ; et ii) dans la transaction entre le membre compensateur et la contrepartie à la transaction alpha initiale.	• Char(20) pour un code LEI - ou • Varchar(72) pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) - ou	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette	N	Transaction – C si [Compensé] = « Y », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁷ Dans les explications des éléments de données du CDE, « contrepartie centrale » s'entend d'une chambre de compensation.

²⁸ Les swaps compensés (« clearing swaps ») doivent être déclarés par la contrepartie déclarante selon le modèle de l'opération pour compte de tiers.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				Dans le cas du modèle de la transaction pour compte de tiers, le membre compensateur est identifié en tant que membre de la chambre de compensation, mais non comme contrepartie aux transactions résultant de la compensation. Dans ce modèle, les contreparties sont la contrepartie centrale et le client. Cet élément de données ne s'applique pas si la valeur de l'élément de données « Compensé » est « N » (non compensé par une contrepartie centrale) ou « I » (compensation prévue).	Varchar(72) code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage	transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.		
76	CFTC	Horodatage de la réception pour compensation	Date et heure, exprimées en temps universel coordonné, auxquelles le dérivé initial a été enregistré comme reçu par la chambre de compensation aux fins de compensation.	La date et l'heure, exprimées en temps universel coordonné (UTC), auxquelles l'organisme de compensation de dérivés reçoit pour compensation le swap conclu à l'origine et l'enregistre dans son système ²⁹ .	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Compensé] = « Y » ou ([Compensé] = « I » et [Type d'action] = « TERM » et [Type d'événement] = « CLRG ») ou ([Compensé] = « I » et « [Type d'action] = « TERM » et [Type d'événement] = « CLAL »), sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
77	CFTC	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1	Type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 1.	Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 1 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert³⁰. Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu.	Char(4)	- AFFL = Dispense intragroupe - OTHR = Autres exceptions ou dispenses Valeurs supplémentaires, pertinentes uniquement pour la CFTC : - ENDU = exception relative à l'utilisateur final; - SMBK = exemption pour les petites banques; - COOP = exemption pour les coopératives; - NOAL = lettre de non-intervention.	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
78	CFTC	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2	Type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 2.	Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 2 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert. Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu.	Char(4)	- AFFL = Dispense intragroupe - OTHR = Autres exceptions ou dispenses Valeurs supplémentaires, pertinentes uniquement pour la CFTC : - ENDU = exception relative à l'utilisateur final; - SMBK = exemption pour les petites banques; - COOP = exemption pour les coopératives; - NOAL = lettre de non-intervention.	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁹ Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « organisme de compensation de dérivés » (expression abrégée en anglais par « DCO ») s'entend d'une chambre de compensation.

³⁰ Voir les chapitres 3 et 5 du *Règlement 94-101 sur la compensation obligatoire des dérivés par contrepartie centrale*. Par ailleurs, la contrepartie déclarante peut présenter, pour les éléments de données 77 et 78, des exceptions à la compensation qui sont pertinentes pour la CFTC. Elle peut donc déclarer ces éléments de données selon les règlements sur la déclaration des opérations de la même manière qu'elle les déclare à la CFTC.

Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
79	CDE	Catégorie de sûreté	Indique s'il existe une convention de sûreté entre les contreparties et précise la nature de la sûreté.	Indique s'il existe une ou plusieurs conventions de sûreté entre les contreparties (sans sûreté/couverture partielle/couverture à sens unique/couverture entière). Cet élément de données est fourni pour chaque transaction ou chaque portefeuille, selon que la constitution de sûreté est faite au niveau de la transaction ou du portefeuille, et est applicable aux transactions compensées ou non.	Char(4)	• UNCL • PRC1 • PRC2 • PRC1 • OWC1 • OWC2 • OWP1 • OWP2 • FLCL	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – NR
80	CFTC	Portefeuille contenant un indicateur de composante à ne pas déclarer	Dans le cas où les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si le portefeuille inclut des dérivés visés par une dispense ou une exception de déclaration.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si ce portefeuille inclut des transactions de swap dispensées de déclaration.	Booléen	• Vrai • Faux	N	Transaction – NR Sûretés – O Valorisation – NR
81	CDE	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante avant l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité à la contrepartie centrale, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés – C si ([Catégorie de sûreté = « OWC1 » ou « OWP1 » ou « FLCL »), sinon (facultatif)] ³¹ Valorisation – NR

³¹ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
82	CDE	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante après l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité à la contrepartie centrale, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés – C si ([Catégorie de sûreté = « OWC1 » ou « OWP1 » ou « FLCL »], sinon {facultatif}) ³² Valorisation – NR
83	CDE	Monnaie de la marge initiale déposée ³³	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales déposées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)] ou [Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)] est utilisé, sinon {champ vide} Valorisation – NR
84	CDE	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante avant l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la contrepartie centrale dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie,	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « OWC2 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif}) ³⁴ Valorisation – NR

³² Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

³³ Dans le cas d'un portefeuille comptant plusieurs monnaies, il faut le convertir en une monnaie unique choisie par la contrepartie déclarante et déclarer une seule valeur totale.

³⁴ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.				
85	CDE	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la contrepartie centrale dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « OWC2 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif} ³⁵ Valorisation – NR
86	CDE	Monnaie de la marge initiale collectée ³⁶	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales collectées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)] ou [Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)] est utilisé, sinon {champ vide} Valorisation – NR

³⁵ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

³⁶ Dans le cas d'un portefeuille comptant plusieurs monnaies, il faut le convertir en une monnaie unique choisie par la contrepartie déclarante et déclarer une seule valeur totale.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
87	CDE	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote) ³⁷	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC1 » ou « PRCL » ou « OWC1 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif}³⁸ Valorisation – NR
88	CDE	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC1 » ou « PRCL » ou « OWC1 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif}³⁹ Valorisation – NR

³⁷ Il est obligatoire de déclarer cet élément de données quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

³⁸ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

³⁹ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentés sous forme d'une valeur totale.				
89	CDE	Monnaie de la marge de variation déposée	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation déposées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)] ou [Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)] est utilisé, sinon {champ vide} Valorisation – NR
90	CDE	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote) ⁴⁰	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation collectées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC2 » ou « PRCL » ou « OWC2 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif} ⁴¹ Valorisation – NR

⁴⁰ Il est obligatoire de déclarer cet élément de données quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

⁴¹ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.				
91	CDE	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation collectée après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentée sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC2 » ou « PRCL » ou « OWC2 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {facultatif}⁴² Valorisation – NR
92	CDE	Monnaie de la marge de variation collectée	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation collectées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)] ou [Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)] est utilisé, sinon {champ vide}

⁴² Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Valorisation – NR
93	CDE	Code du portefeuille de sûretés – marge de variation	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge de variation relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge de variation globale d'un ensemble d'opérations sur dérivés. Cet élément de données ne s'applique pas si la constitution de sûretés a été effectuée au niveau de la transaction, ou s'il n'y a pas de convention de sûreté ou si aucune marge de variation n'est déposée ou reçue.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques ⁴³	N	Transaction – F Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Valorisation – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon {facultatif}
94	CDE	Code du portefeuille de sûretés – marge initiale	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge initiale relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge initiale globale relative à un ensemble d'opérations sur dérivés. Cet élément de données ne s'applique pas si la constitution de sûretés a été effectuée au niveau de la transaction, ou s'il n'y a pas de convention de sûreté ou si aucune marge initiale n'est déposée ou reçue.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques ⁴⁴	N	Transaction – F Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge de variation] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Valorisation – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon {facultatif}

⁴³ Si les sûretés ont été constituées au niveau de l'opération, « TRANSACTIONLEVEL » est accepté. « NOTAPPLICABLE » est accepté si : i) les sûretés ont été constituées au niveau du portefeuille et il n'existe pas de code du portefeuille de sûretés pour la marge de variation; ou ii) la déclaration est transmise par un organisme de compensation de dérivés.

⁴⁴ Si les sûretés ont été constituées au niveau de l'opération, « TRANSACTIONLEVEL » est accepté. « NOTAPPLICABLE » est accepté si : i) les sûretés ont été constituées au niveau du portefeuille et il n'existe pas de code du portefeuille de sûretés pour la marge initiale; ou ii) la déclaration est transmise par un organisme de compensation de dérivés.

Éléments de données relatifs aux actions et aux événements

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
95	CDE	Horodatage de l'événement	La date et l'heure de l'événement relatif à un dérivé.	La date et l'heure de l'événement pour lequel un rapport est établi. Dans le cas d'une modification convenue pour une date future, cet élément de données doit correspondre à la date où la modification a lieu (prend effet) et non à celle où elle est négociée. Dans le cas d'une correction, cet élément de données doit correspondre à la date et à l'heure auxquelles la correction s'applique. Dans le cas d'un événement de compensation, cet élément de données doit correspondre à la date et à l'heure auxquelles la transaction alpha est acceptée pour compensation par la contrepartie centrale. Dans le cas d'une mise à jour des sûretés, la date et l'heure sont celles pour lesquelles les renseignements contenus dans le rapport sont fournis.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC ⁴⁵ .	Toute date ou heure valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – O La valeur sera égale ou postérieure à la valeur de [Horodatage de l'exécution]. Sûretés – O Valorisation – NR
96	CDE	Niveau	Indique si la déclaration se rapporte au dérivé ou à la position.	Indique si la déclaration s'effectue au niveau de l'opération ou à celui de la position. La déclaration au niveau de la position peut être faite en complément de celle au niveau de l'opération pour rendre compte d'événements postérieurs à l'opération et lorsque des opérations considérées individuellement sont remplacées par la position.	Char(4)	• TCTN = Opération • PSTN = Position	N	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
97	CDE	Identifiant d'événement	L'identifiant unique qui lie les dérivés se rapportant à un événement.	L'identifiant unique permettant de lier les transactions constituant un événement et en résultant, cet événement pouvant notamment être une compression ou autre mesure de réduction du risque postérieure à l'opération ou encore un événement de crédit. Cet identifiant unique peut être attribué par la contrepartie déclarante, un fournisseur de service ou la contrepartie centrale qui fournit le service ⁴⁶ .	Varchar(52)	Code LEI ISO 17442 de l'entité qui attribue l'identifiant de l'événement, suivi d'un identifiant unique d'un maximum de 32 caractères.	N	Transaction – C si [Type d'événement] = « COMP » ou « CREV », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
98	CDE	Type d'action ⁴⁷	Précise le type d'action ou de déclaration qui se rapporte au dérivé ou à la position.	Type d'action réalisée à l'égard de la transaction ou type de déclaration de fin de journée. Voir l'annexe 3.8 pour la description des valeurs permises.	Char(4)	• NEWT = Nouveau • MODI = Modifier • CORR = Corriger • EROR = Erreur • REVI = Relancer • TERM = Mettre fin • PRTO = Transférer • VALU = Valorisation	O	Transaction – O – Pour les types d'action ou les types d'événement valides, voir l'annexe 3.5. Sûretés – O, doit correspondre à 'MARU' Valorisation – M doit correspondre à 'VALU'

⁴⁵ La déclaration doit inclure la partie date et la partie heure. Cet élément temporel est aussi précis qu'il est technologiquement possible de le faire. Si la partie heure n'est pas disponible, déclarer « 00:00:00 » à cet égard.

⁴⁶ L'identifiant qui se rapporte à un événement donné doit être le même dans tous les cas.

⁴⁷ Une seule valeur de type d'action par transmission; ne pas transmettre plusieurs valeurs de type d'action en une seule déclaration de transaction. Par exemple, s'il se trouve un élément de données à corriger dans une opération transmise précédemment qui prend fin, la valeur Corriger (CORR) est à transmettre séparément avant l'opération Mettre fin (TERM).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
						• MARU = Mise à jour de sûreté/marge • POSC = Élément de position		
99	CDE	Type d'événement	Précise le type d'événement du cycle de vie ou le motif de l'action dont il est question à l'élément de données 98.	Explication ou motif de l'action réalisée à l'égard de la transaction. Voir l'annexe 3.7 pour la description des valeurs permises.	Char(4)	• TRAD = Opération • NOVA = Novation/intervention • COMP = Mesure de réduction du risque postérieure à l'opération • ETRM = Fin par anticipation • CLRG = Compensation • EXER = Exercice • ALOC = Affectation • CLAL = Compensation et affectation • CREV = Événement de crédit • PTNG = Transfert • INCP = Inclusion dans une position • CORP = Événement d'entreprise • UPDT = Mise à jour	O	Transaction – C – Pour les types d'action ou les types d'événement valides, voir l'annexe 3.5. Sûretés – NR Valorisation – NR
100	CFTC	Indicateur de modification	Indique si une modification du dérivé se rapporte à un événement.	Indique si la modification de la transaction rend compte de la nouvelle version convenue des modalités négociées antérieurement.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – C si [Type d'action] = « MODI », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs à la valorisation

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
101	CDE	Montant de valorisation ⁴⁸	Valeur du dérivé.	La valeur actuelle du contrat en cours sans aucun ajustement d'évaluation (il pourrait s'agir, par exemple, des XVA tels que le CVA, le DVA, etc.). Le montant de valorisation est exprimé en coût de sortie du contrat ou de ses composantes à un moment précis et non pas en variation de la valeur ou en variation cumulative de la valeur pendant une période donnée, c'est-à-dire le prix auquel il serait vendu (sur le marché dans le cadre d'une transaction normale à la date de valorisation). La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).	Num(25,5)	Toute valeur numérique.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
102	CDE	Monnaie de valorisation	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
103	CDE	Méthode de valorisation	La source et la méthode utilisées pour valoriser le dérivé.	La source et la méthode utilisées pour la valorisation de la transaction par la contrepartie déclarante. S'il est utilisé au moins une donnée de valorisation classée sous la catégorie « selon un modèle » (mark-to-model) à l'annexe 3.3, alors toute la valorisation entre dans cette catégorie. Si seules sont utilisées des données de valorisation classées dans la catégorie « au prix du marché » à l'annexe 3.3, alors toute la valorisation entre dans cette catégorie.	Char(1)	• MTMA = Valorisation au prix du marché • MTMO = Valorisation selon un modèle • CCPV = Valorisation par la chambre de compensation (La classification des données de valorisation figure à l'annexe 3.3.)	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O

⁴⁸ Il est obligatoire de déclarer le montant de valorisation quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
104	CDE	Horodatage de la valorisation	La date et l'heure auxquelles a été calculée la valeur du dérivé visé dans l'élément de données 101.	La date et l'heure de la dernière valorisation au prix du marché, fournie par la contrepartie centrale ⁴⁹ ou calculée à l'aide du prix du marché en vigueur ou du dernier prix du marché des données d'entrée.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC ⁵⁰ . Si l'élément temporel n'est pas requis dans une province, un territoire ou un État en particulier, l'heure peut être omise étant donné que, dans le cas de représentations à précision réduite, la norme ISO 8601 permet d'omettre des éléments de la représentation de la date/heure, l'omission commençant par l'extrême droite (dans l'ordre, à partir de l'élément le moins significatif).	Toute date ou heure valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
105	CFTC	Prochaine date de révision du taux variable de référence [prochaine date de révision du taux variable de référence – branche 1] [prochaine date de révision du taux variable de référence – branche 2]	Prochaine date à laquelle le taux variable de référence sera révisé.	La prochaine date à laquelle le taux variable de référence est révisé.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F
106	CFTC	Dernière valeur du taux variable de référence [dernière valeur du taux variable de référence – branche 1] [dernière valeur du taux variable de référence – branche 2]	Valeur du taux variable de référence à la date visée dans l'élément de données 107.	L'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière date de révision du taux variable de référence.	Num(11,10)	Valeurs positives et négatives exprimées en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %)	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F
107	CFTC	Dernière date de révision du taux variable de référence [dernière date de révision du taux variable de référence – branche 1] [dernière date de révision du taux variable de référence – branche 2]	Date la plus récente de la révision du taux variable de référence.	La date de l'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière valeur du taux variable de référence.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F

⁴⁹ Déclarée par la chambre de compensation pour les dérivés compensés et par le courtier en dérivés pour les dérivés non compensés.

⁵⁰ Il n'est pas nécessaire que l'horodatage de la valorisation comprenne l'heure. Le format exigé est AAAA-MM-JJ.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
108	CDE	Delta ⁵¹	Coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix du dérivé et la variation du prix du sous-jacent du dérivé.	Le coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix d'une transaction sur dérivé de gré à gré et la variation du prix du sous-jacent.	Num(25,5)	Toute valeur numérique.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon {facultatif}

Éléments de données relatifs aux paquets

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
109	CFTC	Indicateur de paquet de dérivés	Indication que le dérivé est ou non une composante d'un paquet qui inclut l'un des éléments suivants : a) au moins deux dérivés déclarés séparément par la contrepartie déclarante mais conclus en vertu d'une seule entente; b) au moins deux déclarations relatives au même dérivé si une seule ne peut suffire en raison des obligations de déclaration d'au moins un territoire du Canada ou étranger.	Indique si la transaction de swap fait partie d'un paquet de dérivés.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
110	CDE	Identifiant de paquet de dérivés ⁵²	Identifie le paquet visé à l'élément de données 109.	L'identifiant (établi par la contrepartie déclarante) visant à lier : • au moins deux transactions qui sont déclarées séparément par la contrepartie déclarante, mais négociées ensemble en tant que produit d'une seule entente économique; • au moins deux rapports relatifs à la même transaction dès lors que l'obligation de déclaration dans un territoire ne permet pas sa déclaration dans un seul rapport aux référentiels centraux.	Varchar(100)	Jusqu'à 100 caractères alphanumériques. ⁵⁴	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵¹ Il est obligatoire de déclarer le delta quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

⁵² La déclaration d'une fourchette de taux nécessite l'utilisation de ce champ pour lier les branches plafond et plancher. La déclaration d'un stellingage nécessite l'utilisation de ce champ pour lier les branches swaption payeuse et swaption receveuse.

⁵⁴ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « UNKNOWN ».

Numéro de l'élément de données	Sourc e	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				Un paquet ⁵³ peut contenir des transactions à déclarer et d'autres n'ayant pas à l'être. Cet élément de données ne s'applique pas : • si aucun paquet de dérivés n'est concerné; ou • aux affectations. Si l'identifiant du paquet de dérivés est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu.				
111	CDE	Prix du paquet de dérivés	Prix du paquet visé à l'élément de données 109.	Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont la transaction sur dérivé déclarée est une composante. Cet élément de données ne s'applique pas : • si aucun paquet de dérivés n'est concerné; • si l'écart du paquet de dérivés est utilisé. Les prix et les éléments de données connexes des transactions (Monnaie du prix, Notation du prix, Unité de mesure du prix) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont à déclarer lorsqu'ils sont disponibles. Le Prix du paquet de dérivés peut être inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, mais il est possible de l'actualiser plus tard.	• Num(18,13) si la Notation du prix du paquet de dérivés = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix du paquet de dérivés = 3	• N'importe quelle valeur si la Notation du prix du paquet de dérivés = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix du paquet de dérivés = 3 ⁵⁵	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True » et si [Écart du paquet de dérivés] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
112	CDE	Monnaie du prix du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé.	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque l'écart du paquet de dérivés est utilisé; • lorsque la Notation du prix du paquet de dérivés = 3	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
113	CDE	Écart du paquet de dérivés	Prix du paquet visé à l'élément de données 109, exprimé sous forme d'écart.	Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont la transaction sur dérivé déclarée est une composante. Le Prix du paquet de dérivés lorsque le prix est exprimé en écart, soit la différence entre deux prix de référence. Cet élément de données ne s'applique pas : • aucun paquet de dérivés n'est concerné; le prix du paquet de dérivés est utilisé. L'écart et les éléments de données connexes des transactions (monnaie de l'écart) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont déclarés quand ils sont disponibles. L'Écart du paquet de dérivés peut être inconnu lors de la	• Num(18,13) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 1 • Num(11,10) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 3 • Num(5) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 4	• N'importe quelle valeur si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 3 • N'importe quelle valeur entière exprimée en points de base (par exemple, 257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 4	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True » et si [Prix du paquet de dérivés] n'est pas utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵³ Un « paquet de dérivés » peut aussi être constitué d'une opération impliquant deux instruments ou plus : 1) conclus entre deux contreparties ou plus; 2) évalués ou cotés comme une seule opération économique comportant l'exécution simultanée ou quasi simultanée de tous ses composants; 3) dont l'exécution de chaque composant est conditionnelle à celle des autres composants; 4) dont chaque composant porte un identifiant unique de swap (IUS) ou un identifiant unique de transaction (UTI); et 5) dont chaque composant est déclaré séparément.

⁵⁵ Si la valeur est inconnue, on peut utiliser la valeur par défaut en inscrivant seulement des 9 en tout format autorisé. Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », utiliser « 99999,999999999999 » (18 caractères numériques, dont 13 décimales). Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 3 », utiliser « 9,999999999 » (11 caractères numériques, dont 10 décimales).

Numéro de l'élément de données	Sourc e	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				déclaration d'une nouvelle transaction, mais il est possible de l'actualiser plus tard ⁵⁶ .				
114	CDE	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	Monnaie dans laquelle l'écart du paquet de dérivés est libellé.	La monnaie dans laquelle l'Écart du paquet de dérivés est libellé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque le prix du paquet de dérivés est utilisé; • lorsque l'écart du paquet de dérivés est exprimé en décimales ou en points de base.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
115	CDE	Notation de l'écart du paquet de dérivés	Manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé.	La manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque le prix du paquet de dérivés est utilisé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales • 4 = Points de base	N	Transaction – C si [Écart du paquet de dérivés] est utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
116	CDE	Notation du prix du paquet de dérivés	Manière dont le prix du paquet de dérivés est exprimé.	La manière dont le Prix du paquet de dérivés est exprimé. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun paquet de dérivés n'est concerné.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	N	Transaction – C si [Prix du paquet de dérivés] est utilisé, sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁶ Si la valeur est inconnue, on peut utiliser la valeur par défaut en inscrivant seulement des 9 en tout format autorisé. Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », utiliser « 99999,999999999999 » (18 caractères numériques, dont 13 décimales). Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 3 », utiliser « 9,999999999 » (11 caractères numériques, dont 10 décimales). Lorsque [Notation de l'écart du paquet de dérivés] = « 4 », utiliser « 99999 » (5 caractères numériques, sans décimales).

Éléments de données relatifs au produit

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
117	CDE	Identifiant unique de produit ⁵⁷	Un code unique attribué par le Derivatives Service Bureau qui identifie un type de dérivé.	Un ensemble unique de caractères qui représente le dérivé de gré à gré.	Char(12)	Une liste des valeurs autorisées et de leur format sera publiée par le Derivatives Service Bureau (émetteur de l'Identifiant unique de produit). Jusqu'à ce que ces identifiants uniques de produit soient disponibles, les contreparties déclarantes continueront d'utiliser comme éléments de données relatifs aux produits ceux qui sont uniques à chaque référentiel central.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – O
118	CDE	Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance	Point au-delà duquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance réduit le notionnel d'une tranche.	Le point inférieur défini auquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent réduit le notionnel d'une tranche. Par exemple, le notionnel d'une tranche avec un point d'attachement de 3 % sera réduit après que le portefeuille aura subi des pertes de 3 %. Cet élément de données ne s'applique pas si la transaction ne porte pas sur une tranche du swap sur défaillance (indice ou panier sur mesure).	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	N	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index tranche », sinon {facultatif}; Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit être inférieure à celle de l'élément [Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance]. Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
119	CDE	Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance	Point au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance ne réduisent plus le notionnel d'une tranche.	Le point défini au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent ne réduisent plus le notionnel d'une tranche. Par exemple, le notionnel d'une tranche avec un point d'attachement de 3 % et un point de détachement de 6 % sera réduit après que le portefeuille aura subi des pertes de 3 %. Des pertes de 6 % dans le portefeuille épuiseront le notionnel de la tranche. Cet élément de données ne s'applique pas si la transaction ne porte pas sur une tranche du swap sur défaillance (indice ou panier sur mesure).	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	N	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index tranche », sinon {facultatif}; Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit être supérieure à celle de l'élément [Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance]. Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁷ Le 20 février 2025, les ACVM ont publié la *Décision générale coordonnée 96-933 relative à la dispense temporaire de certaines obligations de déclaration de données sur les dérivés concernant l'identifiant unique de produit pour les dérivés sur marchandises*, qui permet aux participants au marché de continuer à déclarer les identifiants uniques de produit pour les dérivés sur marchandises conformément aux règlements en vigueur à cette date : <https://www.autorites-valeurs-mobilieres.ca/nouvelles/les-acvm-annoncent-loctroi-de-dispenses-temporaires-en-faveur-des-participants-aux-marches-des-derives/>.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
120	CFTC	Facteur d'indice	Facteur de la version de l'indice ou le pourcentage utilisé pour établir le montant notionnel d'un swap sur défaillance.	Le facteur ou pourcentage de la version de l'indice, exprimé en valeur décimale, qui, multiplié par le Montant notionnel, donne le montant notionnel couvert par le vendeur de la protection du swap sur défaillance.	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	O	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index » ou « Index tranche », sinon {facultatif} Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
121	CDE	Indicateur de cryptoactif sous-jacent [indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 1] [indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 2]	Indication que le sous-jacent du dérivé est ou non un cryptoactif.	Indique si le sous-jacent du dérivé est un cryptoactif. Cet élément est à déclarer comme « vrai » si l'un ou l'autre des sous-jacents (le sous-jacent immédiat ou le sous-jacent ultime) est un cryptoactif ou encore lorsque le dérivé repose sur un mélange de cryptoactifs et d'autres sous-jacents.	Booléen	• Vrai si le sous-jacent est un cryptoactif • Faux si le sous-jacent n'est pas un cryptoactif	N	Transaction – CO – O Sûretés – NR Valorisation – NR
122	CDE	Code du panier sur mesure	Identifiant unique pour le panier sur mesure de l'actif de référence.	Si la transaction sur dérivé de gré à gré repose sur un panier sur mesure, le code unique attribué par le structeur du panier afin d'en lier les composants. Cet élément de données ne s'applique pas lorsqu'aucun panier sur mesure n'est en cause ou qu'aucun code unique n'a été attribué au panier.	Varchar(72)	L'identifiant pour les entités juridiques (code LEI) ISO 17442 du structeur du panier ⁵⁸ , suivi d'un identifiant unique d'un maximum de 52 caractères alphanumériques.	N	Transaction – C si [Indicateur de panier sur mesure] = « Vrai », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
123	CFTC	Indicateur de panier sur mesure	Indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un panier sur mesure.	Indique si la transaction de swap repose sur un panier sur mesure.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁸ Le code LEI doit correspondre à celui de l'entité qui attribue le code du panier sur mesure.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
124	CDE	Identifiant des composantes du panier	Identifie un actif de référence composant le panier sur mesure.	L'identifiant qui représente un composant d'un panier sur mesure sous-jacent en phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence des UPI ISO 4914 maintenus par le fournisseur de services UPI ou avec un identifiant qui serait à déclarer comme Identifiant du sous-jacent (Autre) si l'UPI Identifiant du sous-jacent était « AUTRE ». Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Varchar(210) ⁵⁹	Tout identifiant pouvant être utilisé pour désigner un actif, un indice ou une référence compris dans un panier ⁶⁰ .	N	Transaction – C si [Code du panier sur mesure] = « Vrai », sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de l'identifiant de composant du panier doit égaler le nombre de valeurs de l'unité de mesure de composant, du nombre d'unités et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR
125	CDE	Source de l'identifiant des composantes du panier	Source de l'identifiant des composantes du panier visé à l'élément de données 124.	L'origine ou l'éditeur de l'identifiant de composant du panier associé, en phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence des UPI ISO 4914 maintenus par le fournisseur de services UPI ou avec la valeur permise qui serait à déclarer comme Identifiant du sous-jacent (Autre) si l'UPI Identifiant du sous-jacent était « AUTRE ». Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Varchar(100) ⁶¹	L'origine ou l'éditeur ⁶² de l'identifiant de composant du panier associé.	N	Transaction – C si [Identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de l'identifiant de composant du panier doit égaler le nombre de valeurs de l'identifiant de composant, de l'unité de mesure et du nombre d'unités. Sûretés – NR Valorisation – NR
126	CDE	Nombre d'unités des composantes du panier	Nombre d'unités de chaque actif de référence composant le panier sur mesure.	Le nombre d'unités d'un composant particulier d'un panier sur mesure. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Num(18,13)	Toute valeur supérieure à zéro ⁶³ .	N	Transaction – C si [Identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon {facultatif} Le nombre de valeurs du nombre d'unités de composant du panier doit égaler le nombre de valeurs de l'identifiant de composant, de l'unité de

⁵⁹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶⁰ En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

⁶¹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶² En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

⁶³ Dans le cas d'un panier de marchandises qui comporte une formule de calcul utilisant différentes pondérations d'indices, fournir les valeurs sans le symbole de pourcentage. Par exemple, pour 10 %, déclarer « 10 ».

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								mesure et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR
127	CDE	Unité de mesure des composantes du panier	Unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités visé dans l'élément de données 126.	Unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités d'un composant particulier d'un panier sur mesure. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Varchar(4)	Jeu de codes d'unités de mesure externe conforme à ISO 20022 ⁶⁴	N	Transaction – C si [l'identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon {facultatif} Le nombre de valeurs de l'unité de mesure de composant du panier doit égaliser le nombre de valeurs de l'identifiant de composant, du nombre d'unités et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR
128	CDE	Identifiant du sous-jacent (Autre) [identifiant du sous-jacent (Autre) – branche 1] [identifiant du sous-jacent (Autre) – branche 2]	Identifie chaque élément sous-jacent du dérivé.	Les actifs, indices ou références sous-jacents au contrat ou, dans le cas d'un dérivé de change, l'identifiant de l'indice. Cet élément de données ne s'utilise que lorsque la valeur de l'identifiant du sous-jacent transmise au fournisseur de service UPI est « AUTRE » ⁶⁵ .	Varchar(210) ⁶⁶	Tout identifiant ⁶⁷ pouvant être utilisé pour désigner les actifs, indices ou références sous-jacents à un contrat. Jusqu'à 210 caractères alphanumériques. Pour un « Identifiant du sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, soit la source de données de référence des énumérations du fournisseur de services UPI pour ces identifiants, se reporter à la rubrique 3.9 de l'Annexe.	N	Transaction – C si [l'identifiant du sous-jacent ⁶⁸] = « Autre », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶⁴ Autres codes d'unités de mesure approuvés pour la DD (liés aux transactions sur cryptoactifs) permis pour les ACVM.

⁶⁵ Lorsqu'un identifiant de sous-jacent particulier n'est pas pris en charge par le fournisseur de services UPI (cet identifiant du sous-jacent est « Autre »), c'est dans ce champ qu'on le déclare au référentiel central.

⁶⁶ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶⁷ En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

⁶⁸ Dépendamment du produit, il se peut que le DSB utilise, pour désigner l'actif ou l'indice sous-jacent au dérivé, des attributs portant des noms tels que Taux de référence, Indice de l'instrument sous-jacent, ISIN de l'instrument sous-jacent, LEI de l'instrument sous-jacent ou autres.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
129	CDE	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) [source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) - branche 1] [source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) - branche 2]	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) visé dans l'élément de données 128.	L'origine ou l'éditeur de l'identifiant du sous-jacent (autre) associé. Cet élément de données ne s'utilise que lorsque la valeur de la source de l'identifiant du sous-jacent transmise au fournisseur de service UPI est « AUTRE »	Varchar(100) ⁶⁹	L'origine ou l'éditeur ⁷⁰ de l'identifiant du sous-jacent associé. Jusqu'à 100 caractères alphanumériques. Pour une « Source de l'identifiant du sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, soit la source de données de référence des énumérations du fournisseur de services UPI pour ces identifiants, se reporter à la rubrique 3.10 de l'Annexe.	N	Transaction – C si [l'identifiant du sous-jacent (autre)] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
130	CDE	Identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent [identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent - branche 1] [identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent - branche 2]	Identifie la plateforme sur laquelle est négocié le sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	Pour un actif sous-jacent négocié sur une plateforme (p. ex., une bourse), la plateforme sur laquelle cet actif se négocie ⁷¹ . Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré qui portent sur les composants d'un panier sur mesure.	Char(4)	Code d'identification de marché de segment ISO 10383	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
131	CDE	Source du prix de l'actif sous-jacent [source du prix de l'actif sous-jacent – branche 1] [source du prix de l'actif sous-jacent – branche 2]	Source du prix utilisé pour établir la valeur ou le niveau du sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	Pour un actif sous-jacent ou une référence qui ne sont pas négociés sur une plateforme, la source de prix ayant servi à déterminer la valeur ou le niveau de l'actif ou de la référence. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré qui portent sur les composants d'un panier sur mesure.	Varchar(50) ⁷²	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques.	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶⁹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁷⁰ En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

⁷¹ La plateforme déclarée doit être celle d'où provient le prix de l'actif sous-jacent.

⁷² Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
132	CFTC	Type d'option incorporée	Type de disposition facultative dans un dérivé.	Le type d'option ou de disposition facultative incorporée dans un contrat.	Char(4)	• MDET = Fin par anticipation obligatoire • OPET = Fin par anticipation facultative • CANC = Annulable • EXT D = Renégociable • OTHR = Autre	O	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux paiements et au règlement

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
133	CDE	Date contractuelle de règlement définitif	Date précisée dans la convention à laquelle il faut avoir rempli toutes les obligations prévues par le dérivé.	Date non ajustée prévue par le contrat à laquelle tous les transferts d'espèces ou d'actifs devraient avoir lieu et les contreparties ne devraient plus avoir d'obligations réciproques impayées en vertu du contrat. Pour les produits qui peuvent ne pas avoir de date contractuelle de règlement définitif (par exemple, les options américaines), cet élément de données reflète la date à laquelle le transfert d'espèces ou d'actifs s'effectuerait si la fin avait lieu à la date d'expiration.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	N'importe quelle date valide.	N	Transaction – C si l'UPI [Retour ou paiement] ≠ « Contrat sur différence (CFD) », sinon {facultatif}. Lorsque cet élément est utilisé, la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Date d'expiration]. Sûretés – NR Valorisation – NR
134	CDE	Lieu de règlement	Lieu de règlement du dérivé.	Le lieu de règlement de la transaction prévu dans le contrat. Cet élément de données ne s'applique qu'aux transactions visant une monnaie étrangère (soit une monnaie ne figurant pas sur la liste de monnaies de la norme ISO 4217, par exemple le CNH).	Char(2)	Codes de pays de la norme ISO 3166 utilisant un code à deux lettres (alpha-2)	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
135	CDE	Monnaie de règlement [monnaie de règlement – branche 1] [monnaie de règlement – branche 2]	À l'égard de chaque branche du dérivé, la monnaie dans laquelle le règlement en espèces est libellé.	La monnaie du règlement en espèces, le cas échéant. Pour les produits en plusieurs monnaies qui ne sont pas compensés, la monnaie de règlement de chaque branche. Cet élément de données ne s'applique pas aux produits compensés par la livraison physique de marchandises (par exemple, les swaptions compensées par la livraison physique de marchandises).	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	O	Transaction – C si UPI.[Type de remise] = « Cash », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
136	CDE	Montant de l'autre paiement ⁷³	Montant de chaque paiement prévu par un dérivé, à l'exception du montant de la prime de l'option visé dans l'élément de données 144.	Les montants de paiement avec les types de paiements correspondants afin de tenir compte des obligations relatives aux descriptions des transactions pour différentes catégories d'actifs.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – C si [Type d'autre paiement] est utilisé, sinon {champ vide} Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit égaler le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR
137	CDE	Monnaie de l'autre paiement	Monnaie dans laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 est libellé.	La monnaie dans laquelle le Montant de l'autre paiement est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon {champ vide} Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit égaler le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR
138	CDE	Date de l'autre paiement	Date à laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 sera payé.	La date non ajustée à laquelle le Montant de l'autre paiement est versé.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon {champ vide} Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit égaler le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR

⁷³ Dans le cas de paiements multiples, la série d'éléments de données se rattachant aux autres paiements (Type d'autre paiement [#141], Montant de l'autre paiement [#136], Date de l'autre paiement [#138], Payeur de l'autre paiement [#139], Receveur de l'autre paiement [#140]) peuvent être déclarée plusieurs fois.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
139	CDE	Payeur de l'autre paiement	Identifie le payeur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	L'identifiant du payeur du Montant de l'autre paiement.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon (champ vide) Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit égaler le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR
140	CDE	Receveur de l'autre paiement	Identifie le receveur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	Identifiant du receveur du montant de l'autre paiement.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon (champ vide) Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit égaler le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR
141	CDE	Type de l'autre paiement	Motif du paiement visé dans l'élément de données 136.	Le type de Montant de l'autre paiement. Le paiement de la prime de l'option n'est pas inclus en tant que type de paiement, car les primes de la sorte sont déclarées à l'aide de l'élément de données qui y est consacré.	Char(4)	• UFRO = Paiement forfaitaire unique, c'est-à-dire le paiement initial effectué par l'une des contreparties pour ramener une transaction à sa juste valeur ou pour toute autre raison pouvant être à l'origine d'une transaction hors marché. • UWIN = Rétrocession ou fin complète, c'est-à-dire le paiement de règlement définitif effectué lorsqu'une transaction fait l'objet d'une rétrocession avant sa date de fin; paiements pouvant résulter de la fin complète d'une ou de plusieurs transactions sur dérivés. • PEXH = Échange de notionnel, c'est-à-dire un échange des valeurs notionnelles pour des swaps sur devises.	O	Transaction – CR C, au moins un de ces éléments est requis : ((Taux fixe) ou [Écart] ou [Type d'autre paiement] = « UFRO »), sinon {facultatif} Les valeurs autorisées UWIN et PEXH sont facultatives et indépendantes de la condition ci-dessus. Transaction – IR/FX/EQ/CO F

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Sûretés – NR Valorisation – NR
142	CDE	Fréquence des paiements – unité de temps ⁷⁴ [fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 1] [fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 2] [fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 1] [fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des paiements.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : l'unité de temps associée à la fréquence des paiements, par exemple, jour, mois, année ou durée du flux.	Char(4)	• DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • YEAR = Annuelle • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers) • EXPI⁷⁵ = Paiement à l'échéance	O	Transaction – CR/IR/EQ/CO F Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
143	CDE	Fréquence des paiements – multiplicateur [fréquence des paiements – multiplicateur – taux fixe – branche 1] [fréquence des paiements – multiplicateur – taux fixe – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, le nombre par lequel les unités de temps de la fréquence des paiements sont multipliées afin d'établir la fréquence des dates des paiements périodiques.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : le nombre d'unités de temps (exprimé par la Fréquence des paiements – unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates des paiements périodiques surviennent. Par exemple, une transaction dont les paiements ont lieu tous les deux mois est représentée par une Fréquence des paiements – unité de temps de « MNTH » (mensuelle) et une Fréquence des paiements – multiplicateur de « 2 ». Cet élément de données ne s'applique pas si la Fréquence des paiements – unité de temps est « ADHO ». Si elle est « EXPI », la Fréquence des paiements – multiplicateur est « 1 ». Si elle est intrajournalière, la Fréquence des paiements – unité de temps est	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – CR/IR/EQ/CO C si [Fréquence des paiements – unité de temps] ≠ « ADHO », sinon (champ vide). Lorsque [Fréquence des paiements – unité de temps] contient la valeur « EXPI », [Fréquence des paiements – multiplicateur] doit être « 1 » Transaction – FX – NR

⁷⁴ Pour représenter un paiement trimestriel, déclarer [Fréquence des paiements – unité de temps] = « MNTH » et [Fréquence des paiements – multiplicateur] = « 3 ». Pour un paiement semestriel, déclarer [Fréquence des paiements – unité de temps] = « MNTH » et [Fréquence des paiements – multiplicateur] = « 6 ».

⁷⁵ Pour la valeur autorisée « EXPI » des éléments qui concernent l'unité de temps, on trouve dans le *Manuel technique* deux descriptions différentes, « Paiement à l'échéance » et « Fin du contrat », qui signifient essentiellement la même chose et représentent la fréquence/le taux de paiement/quantité.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
		[fréquence des paiements – multiplicateur – taux variable – branche 1] [fréquence des paiements – multiplicateur – taux variable – branche 2]		« DAIL » et la Fréquence des paiements – multiplicateur est « 0 ».				Sûretés – NR Valorisation – NR
144	CDE	Montant de la prime de l'option	Prime payée par l'acheteur d'une option ou d'une swaption.	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, le montant monétaire payé par l'acheteur de l'option. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
145	CDE	Monnaie de la prime de l'option	Monnaie dans laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est libellée.	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, la monnaie dans laquelle la prime de l'option est libellée. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – C si [Montant de la prime de l'option] > 0, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
146	CDE	Date de paiement de la prime de l'option	Date à laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est payée.	La date non ajustée à laquelle la prime de l'option est payée.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Montant de la prime de l'option] > 0, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
147	CDE	Première date d'exercice	Première date à laquelle une option peut être exercée.	La première date non ajustée à laquelle une option peut être exercée durant la période d'exercice. Pour les options de type européen, cette date correspond à la Date d'expiration. Pour celles de type américain, la première date d'exercice possible est la date non ajustée indiquée dans l'Horodatage de l'exécution. Dans le cas des options barrières activantes, lorsque la première date d'exercice est inconnue au moment de la déclaration d'une nouvelle transaction, cet élément de données est actualisé lorsqu'elle devient disponible. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.				
148	CFTC	Date de fixation [date de fixation – branche 1] [date de fixation – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la date à laquelle le taux de référence est établi.	La date précise à laquelle est « fixé » à un contrat à terme de gré à gré non livrable, ainsi qu'à divers types d'options sur devises de gré à gré comme les options réglées en espèces, un taux de change particulier, qui servira à calculer le règlement en espèces ultime.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CR/IR/EQ/CO F Transaction – FX C si UPI.[Type d'instrument] = « Forward » ou « Option » et si UPI.[Type de remise] = « Cash », sinon {facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

2.1 Lignes directrices pour la déclaration des positions

Nom de l'élément de données	Explication détaillée de l'élément de données	Déclaration de positions
Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	Lorsque l'identifiant de l'acheteur est pertinent, la détermination de l'acheteur/du vendeur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation;	Lorsque l'identifiant du vendeur est pertinent, la détermination de l'acheteur/du vendeur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.

	• les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	
Identifiant du payeur [identifiant du payeur – branche 1] [identifiant du payeur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	Lorsque l'identifiant du payeur est pertinent, la détermination du payeur/receveur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Identifiant du receveur [identifiant du receveur – branche 1] [identifiant du receveur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	Lorsque l'identifiant du receveur est pertinent, la détermination du payeur/du receveur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Date d'entrée en vigueur	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré entrent en vigueur.	Date d'entrée en vigueur initialement déclarée lorsque la position a été acquise.
Identifiant unique de transaction (UTI)	Un identifiant unique attribué à tous les dérivés déclarés au niveau de la transaction ou de la position, qui sert à les identifier de manière unique pendant tout leur cycle de vie dans l'ensemble des dossiers.	Nouvel UTI créé pour la position
Montant notionnel [montant notionnel – branche 1] [montant notionnel – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : • pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires, le montant stipulé dans le contrat; • pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires, se reporter à l'annexe 3.1 pour la conversion des montants notionnels en des montants non monétaires. De plus : • pour les transactions sur dérivés de gré à gré prévoyant un tableau de montants notionnels, le montant notionnel initial convenu par les contreparties au début de la transaction est déclaré sous cet élément de données; • pour les options sur devises de gré à gré, outre cet élément de données, les montants sont déclarés au moyen des éléments de données Montant d'achat et Montant de vente; • pour les modifications ou les événements du cycle de vie, le montant notionnel en cours qui en résulte est déclaré (les réalisations des étapes des tableaux des montants notionnels ne sont pas considérées comme des modifications ou des événements du cycle de vie); • si le montant notionnel est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, cet élément de données est actualisé dès qu'il devient disponible.	Le montant notionnel correspond au résultat net des éléments de la position acheteur/vendeur ou payeur/receveur.
Montant d'achat	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	Le montant d'achat correspond à la somme de tous les montants d'achat inclus dans la position.
Montant de vente	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit de vendre.	Le montant de vente correspond à la somme de tous les montants de vente inclus dans la position.
Quantité notionnelle [quantité notionnelle – branche 1] [quantité notionnelle – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : relativement aux transactions sur dérivés négociées en montants non monétaires prévoyant une quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau (par exemple, 50 barils par mois). La fréquence est déclarée dans la Fréquence de cotation de la quantité, et l'unité de mesure est l'Unité de mesure de la quantité.	La quantité notionnelle correspond à la quantité notionnelle nette des éléments de la position acheteur/vendeur.
Quantité notionnelle totale [quantité notionnelle totale – branche 1] [quantité notionnelle totale – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la Quantité notionnelle globale de l'actif sous-jacent pendant la durée de la transaction. Lorsque la Quantité notionnelle totale est inconnue au moment de la déclaration de la nouvelle transaction, elle doit être mise à jour dès qu'elle est connue.	La quantité notionnelle totale correspond à la quantité notionnelle totale nette des éléments de la position acheteur/vendeur.

Prix	Le prix spécifié de la transaction sur dérivé de gré à gré, les frais, droits, taxes et commissions étant exclus. Pour les swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et les produits semblables avec paiements périodiques, cet élément de données renvoie au prix fixe de la ou des branches fixes. Pour les contrats à terme sur marchandises et sur actions de gré à gré et les produits semblables, il renvoie au prix à terme de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les contrats sur différence et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent. Cet élément de données ne s'applique pas dans les cas suivants : • Les swaps de taux d'intérêt et les contrats de garantie de taux de gré à gré, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe et Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur taux d'intérêt et les swaptions sur taux d'intérêt, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps de référence sur marchandises et la branche variable des swaps sur marchandises à taux fixe-variable, car il est entendu que les renseignements inclus dans l'élément de données Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps, contrats à terme de gré à gré et contrats d'option sur devises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux de change, Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur actions, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps sur défaillance et les swaps sur rendement total de crédit, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe, Écart et Paiement forfaitaire unique (Type d'autre paiement : Paiement forfaitaire unique) peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. Si le prix est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu. Pour les transactions qui font partie d'un paquet, cet élément de données contient le prix de la transaction qui en est une composante, le cas échéant.	Prix moyen pondéré en fonction du volume.
Écart [écart – branche 1] [écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques (par exemple, swaps fixe-variable, swaps variable-variable, swaps sur marchandises) : • soit l'écart sur le prix établi par référence à un indice de la ou des branches variables, lorsqu'il existe un écart pour une ou plusieurs branches variables (par exemple, USD-LIBOR-BBA plus 0,03 ou WTI moins 14,65 USD) • soit la différence entre les prix établis par référence à un indice de chacune des branches variables (par exemple, l'écart de 9,00 USD pour un swap de référence WCS-WTI lorsque le WCS est évalué à 43 USD et le WTI à 52 USD).	Écart moyen pondéré en fonction du volume.
Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournie à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Somme des marges initiales déposées pour tous les dérivés de la même position.
Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournie à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande.	Somme des marges initiales déposées pour tous les dérivés de la même position.

	Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	
Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges initiales collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges initiales collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation déposées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation déposées pour tous les dérivés de la même position.

Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation qui a été collectée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation collectée après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentée sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation collectées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation collectées pour tous les dérivés de la même position.
Montant de valorisation	La valeur actuelle du contrat en cours. Le montant de valorisation est exprimé en coût de sortie du contrat ou de ses composantes, c'est-à-dire le prix auquel il serait vendu (sur le marché dans le cadre d'une transaction normale à la date de valorisation).	La somme des montants de valorisation de tous les dérivés de la position ou la valorisation de la position même si elle est évaluée comme un seul élément.
Date contractuelle de règlement définitif	Date non ajustée prévue par le contrat à laquelle tous les transferts d'espèces ou d'actifs devraient avoir lieu et les contreparties ne devraient plus avoir d'obligations réciproques impayées en vertu du contrat. Pour les produits qui peuvent ne pas avoir de date contractuelle de règlement définitif (par exemple, les options américaines), cet élément de données reflète la date à laquelle le transfert d'espèces ou d'actifs s'effectuerait si la fin avait lieu à la date d'expiration.	Date la plus éloignée parmi toutes les dates contractuelles de règlement définitif pour tous les dérivés de la position.

3 Annexe

Tirée de la version 4 des orientations techniques CDE, *Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*⁷⁶.

3.1 Montant notionnel

Produit	Montant converti
Options sur actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Contrats à terme sur actions de gré à gré et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix du contrat à terme de gré à gré par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps sur dividendes d'actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice fixé pour la période par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps d'actions, swaps de portefeuille et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps de variance d'actions et produits semblables	Montant notionnel du véga
Swaps de volatilité d'actions et produits semblables	Montant notionnel du véga
CFD sur actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Options sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice par la quantité notionnelle totale
Contrats à terme sur marchandises de gré à gré et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix du contrat à terme de gré à gré par la quantité notionnelle totale
Swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix fixe par la quantité notionnelle totale
Swaps variable-variable sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du dernier prix au comptant disponible au moment de la transaction comportant l'actif sous-jacent de la branche sans écart par la quantité notionnelle totale de la branche sans écart
Swaptions sur marchandises et produits semblables	Montant notionnel du contrat sous-jacent
CFD sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par la quantité notionnelle totale

Notes afférentes au tableau de conversion pour les dérivés négociés en montants non monétaires

Note 1 : pour les dérivés dont l'unité de mesure de la quantité diffère de l'unité de mesure du prix, on convertit le prix ou la quantité totale en une unité de mesure unifiée.

⁷⁶ Version 4 des orientations techniques CDE, *Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*, https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf.

Note 2 : si cela s'applique au dérivé, le montant notionnel tient compte des multiplicateurs et des droits d'option.

Note 3 : pour les contrats de type panier, le montant notionnel du dérivé est la somme des montants notionnels de chaque composant du panier.

3.2 Mise en correspondance des valeurs autorisées par la convention de calcul des jours avec les valeurs ISO 2002, FpML et FIX/FIXML

Valeur autorisée	Nom ISO 2002	Définition ISO 2002 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A001	IC30360ISDAor30360AmericanBasisRule	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février, et à condition que la période d'intérêts ait commencé le 30 ^e ou le 31 ^e jour d'un mois donné. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour si la période a commencé le 30 ou le 31 d'un mois donné et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Il s'agit de la méthode 30/360 la plus couramment utilisée pour les obligations américaines classiques et convertibles.	1	30/360 (30U/360 Bond Basis)	Principalement utilisé aux États-Unis avec les règles d'ajustement de date suivantes : 1) si l'investissement est en fin de mois et la Date1 est le dernier jour de février et la Date2 est le dernier jour de février, alors il faut remplacer la Date2 par 30; 2) si l'investissement est en fin de mois et la Date1 est le dernier jour de février, alors il faut remplacer la Date1 par 30; 3) si la Date2 est le 31 et la Date1 est le 30 ou le 31, alors il faut remplacer la Date2 par 30; 4) si la Date1 est le 31, alors il faut remplacer la Date1 par 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f). [Nom symbolique : ThirtyThreeSixtyUS]	30/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e). Le nombre de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 360, calculé selon la formule suivante : base de calcul = $[360 \times (A2 - A1) + 30 \times (M2 - M1) + (J2 - J1)] / 360$. « J1 » est le premier jour civil, exprimé par une valeur numérique, de la période de calcul ou de la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J1 aura la valeur 30; et « J2 » est le jour civil, exprimé par une valeur numérique, qui suit immédiatement le dernier jour inclus dans la période de calcul ou la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31 et si J1 est supérieur à 29, auquel cas J2 aura la valeur 30 ⁸⁰ .

⁷⁷ Les informations contenues dans cette colonne renvoient au dictionnaire de données ISO 2002.

⁷⁸ La source des informations contenues dans cette chronique est la FIX Trading Community, <http://fixmate.fixtrading.org/latestEP/>.

⁷⁹ Les définitions contenues dans le présent document sont protégées par le droit d'auteur de 2006 de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) et sont reproduites avec l'autorisation de l'ISDA. Tous droits réservés.

⁸⁰ Notez que l'algorithme défini pour cette fraction du nombre de jours a changé entre les Définitions ISDA 2000 et les Définitions ISDA 2006. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A002	IC30365	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours, d'une manière similaire à la méthode 30/360 (basic rule), et d'une année de 365 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e).					
A003	IC30Actual	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours d'une manière similaire à la méthode 30/360 (basic rule) et le nombre supposé de jours dans une année est calculé d'une manière similaire à la règle Actual/Actual (ICMA). Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Le nombre supposé de jours dans une année est calculé comme le nombre réel de jours dans la période du coupon multiplié par le nombre de paiements d'intérêts dans l'année.					
A004	Actual360	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt et dans une année de 360 jours.	6	Act/360	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 360. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e). [Nom symbolique : ActThreeSixty]	ACT/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 360.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A005	Actual365Fixed	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt et dans une année de 365 jours.	7	Act/365 (FIXED)	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 365. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d). [Nom symbolique : ActThreeSixtyFiveFixed]	ACT/365. FIXED	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 365.
A006	ActualActualICMA	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus et du nombre supposé de jours dans une année, c'est-à-dire le nombre réel de jours dans la période de coupon multiplié par le nombre de paiements d'intérêts dans l'année. Si la période de coupon est irrégulière (premier ou dernier coupon), elle est prolongée ou divisée en périodes de quasi-intérêts qui ont la durée d'une période de coupon régulière. Le calcul est alors effectué séparément sur chaque période de quasi-intérêts et les résultats intermédiaires sont additionnés.	9	Act/Act (ICMA)	Le dénominateur est le nombre réel de jours de la période de coupon multiplié par le nombre de périodes de coupon dans l'année. Cette méthode suppose que les coupons réguliers tombent toujours le même jour du mois, lorsque cela est possible. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). [Nom symbolique : ActActICMA]	ACT/ACT. ICMA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). Ce code de fractionnement du nombre de jours est applicable aux transactions comptabilisées conformément aux définitions de 2006 de l'ISDA. Les transactions effectuées aux termes des définitions de 2000 de l'ISDA doivent plutôt utiliser le code ACT/ACT.ISMA. Une fraction égale au « nombre de jours courus/nombre de jours dans l'année » au sens de la Règle 251 des statuts, règlements, règles et recommandations de l'International Capital Markets Association (le « Livre des Règles de l'ICMA »), calculée conformément à la Règle 251 du Livre des Règles de l'ICMA telle qu'elle s'applique aux obligations classiques et convertibles non libellées en dollars américains émises après le 31 décembre 1998, comme si le coupon d'intérêt d'une obligation était calculé pour une période de coupon correspondant à la période de calcul ou à la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est

Valeur autori sée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXM L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A007	IC30E360orEuroBondBasismodel1	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Toutefois, si le dernier jour de la période du coupon d'échéance est le dernier jour de février, ce jour ne sera pas considéré comme étant équivalent au 30 février. Il s'agit d'une variante de la méthode 30/360 (ICMA) couramment utilisée pour les euro-obligations. L'utilisation de cette variante n'est pertinente que lorsque la fin des périodes de coupon est prévue pour le dernier jour du mois.	5	30E/360 (ISDA)	Les règles d'ajustement des dates sont les suivantes : 1) si Date1 est le dernier jour du mois, il faut remplacer la Date1 par 30; 2) si J2 est le dernier jour du mois (sauf si Date2 est la date d'échéance et si Date2 est en février), il faut remplacer la Date2 par 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (h). [Nom symbolique : ThirtyEThreeSixtyISDA]	30E/360.I SDA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (h). Il convient de noter que l'algorithme de cette fraction du nombre de jours aux termes des définitions de 2006 de l'ISDA est conçu pour donner les mêmes résultats en pratique que la version de la fraction du nombre de jours 30E/360 présentée dans les définitions de 2000 de l'ISDA. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement. Le nombre de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation pour laquelle le paiement est effectué, divisé par 360, calculé sur la base d'une formule comme suit : base de calcul = $[360 * (A2 - A1) + 30 * (M2 - M1) + (J2 - J1)] / 360$. « J1 » est le premier jour civil, exprimé par une valeur numérique, de la période de calcul ou de la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J1 aura la valeur 30; « J2 » est le jour civil, exprimé par une valeur numérique, qui suit immédiatement le dernier jour inclus dans la période de calcul ou la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J2 aura la valeur 30.
A008	ActualActualISDA	Méthode par laquelle l'intérêt est calculé sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt qui tombent dans une année normale, divisé par 365, ajouté au nombre réel de jours dans la période d'intérêt qui tombent dans une année bissextile, divisé par 366.	11	Act/Act (ISDA)	Le dénominateur varie selon qu'une partie de la période de calcul concernée tombe dans une année bissextile. Pour la partie de la période de calcul qui tombe dans une année bissextile, le dénominateur est 366 et pour la partie qui ne tombe pas dans une année bissextile, le dénominateur est 365. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b). [Nom symbolique : ActActISDA]	ACT/ACT. ISDA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b). À noter qu'en passant de la recommandation FpML 2.0 à la recommandation provisoire FpML 3.0, le code « ACT/365.ISDA » est devenu « ACT/ACT.ISDA ». Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation pour laquelle le paiement est effectué divisé par 365 (ou, si une partie de cette période de calcul ou de cette période de capitalisation tombe dans une année bissextile, la somme : i) du nombre réel de jours de cette partie de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombant dans une année bissextile, divisé par 366; et ii) du nombre réel de jours de cette partie de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombant dans une année non bissextile, divisé par 365).

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A009	Actual365LorActuActubasisRule	Méthode par laquelle l'intérêt est calculé sur la base du nombre réel de jours courus et d'une année de 365 jours (si la date de paiement du coupon ne tombe PAS dans une année bissextile) ou d'une année de 366 jours (si la date de paiement du coupon tombe dans une année bissextile).	14	Act/365L	Le nombre de jours dans une période est égal au nombre réel de jours. Le nombre de jours dans une année est 365, ou 366 si la période se termine dans une année bissextile. Utilisée pour les billets à taux variable en livres sterling. Peut également être appelée Année ISMA. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (i). [Nom symbolique : ActThreeSixtyFiveL]	ACT/365L	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (i). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 365 (ou si la dernière date de fin de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombe dans une année bissextile, divisé par 366).
A010	ActualActualAFB	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus et d'une année de 366 jours (si le 29 février tombe dans la période de coupon) ou d'une année de 365 jours (si le 29 février ne tombe pas dans la période de coupon). Si une période de coupon est supérieure à un an, elle est divisée en séparant de manière répétitive des sous-périodes d'une année complète en comptant à rebours à partir de la fin de la période de coupon (une année à rebours à partir du 28 février étant le 29 février, le cas échéant). La première des sous-périodes commence à la date de début de la période d'intérêts courus et peut donc être inférieure à un an. Ensuite, le calcul des intérêts est effectué séparément pour chaque sous-période et les résultats intermédiaires sont additionnés.	8	Act/Act (AFB)	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2; le dénominateur est soit 365 (si la période de calcul n'inclut pas le 29 février), soit 366 (si la période de calcul inclut le 29 février). Voir également la Convention-cadre de l'AFB relative aux opérations sur instruments financiers – opérations sur taux d'intérêt (2004), article 4, « Calcul des montants fixes et des montants variables », paragraphe 7, « Base de calcul », alinéa (i). [Nom symbolique : ActActAFB]	ACT/ACT. AFB	Le montant fixe/variable sera calculé selon la fraction du nombre de jours « BASE EXACT/EXACT », comme définie dans les « Définitions communes à plusieurs additifs techniques » publiées par l'Association Française des Banques en septembre 1994. Le dénominateur est soit 365 (si la période de calcul n'inclut pas un 29 février), soit 366 (si la période de calcul inclut un 29 février) – lorsqu'il s'agit d'une période de plus d'un an, deux calculs ou plus sont effectués : les intérêts sont calculés pour chaque année complète, en comptant à rebours à partir de la fin de la période de calcul, et la période initiale restante du talon est traitée conformément à la règle habituelle. Lors du décompte à rebours à cette fin, si le dernier jour de la période concernée est un 28 février, l'année complète doit être décomptée à partir du 28 février précédent, à moins qu'il n'existe un 29 février, auquel cas le 29 février doit être utilisé.
A011	IC30360ICMAor30360basicrule	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Il s'agit de la méthode 30/360 la plus couramment utilisée pour les obligations classiques et convertibles autres qu'américaines émises avant le 1 ^{er} janvier 1999.	4	30E/360 (Eurobond basis)	Également connue sous le nom de 30/360. ISMA, 30S/360, ou méthode allemande spéciale. Les règles d'ajustement des dates sont les suivantes : 1) si la Date1 tombe le 31 ^e jour du mois, elle devient le 30; 2) si la Date2 tombe le 31 ^e jour du mois, elle devient le 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (g). [Nom symbolique : ThirtyEThreeSixty]	30E/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (g) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f). Notez que l'algorithme défini pour cette fraction du nombre de jours a changé entre les Définitions ISDA 2000 et les Définitions ISDA 2006. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A012	IC30E2360orEurobondbasismodel2	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement correspondant au dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, à l'exception du dernier jour de février dont la valeur du jour du mois est adaptée à la valeur du premier jour de la période d'intérêt si cette dernière est plus élevée et si la période fait partie d'un calendrier régulier. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février d'une année non bissextile est considéré comme étant équivalent au 29 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 29, ou au 30 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois. Le 29 février d'une année bissextile est considéré comme étant équivalent au 30 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois. De même si la période de coupon commence le dernier jour de février, elle est supposée produire un seul jour d'intérêt en février comme si elle commençait le 30 février lorsque la fin de la période est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois, ou deux jours d'intérêt en février lorsque la fin de la période est le 29 février, ou trois jours d'intérêt en février lorsqu'il s'agit du 28 février d'une année non bissextile et que la fin de la période est antérieure au 29.					

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A013	IC30E3360orEurobondbasismodel3	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Il s'agit d'une variante de la méthode 30E/360 (Eurobond basis) selon laquelle le dernier jour de février est toujours considéré comme étant équivalent au 30 février, même s'il s'agit du dernier jour de la période du coupon à l'échéance.					
A014	Actual365NL	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, en excluant tout jour intercalaire du décompte, et d'une année de 365 jours.	15	NL365	Le nombre de jours d'une période est égal au nombre réel de jours, à l'exception des jours intercalaires (29 février) qui ne sont pas pris en compte. Le nombre de jours d'une année est de 365, même en cas d'année bissextile. [Nom symbolique : NLThreeSixtyFive]		
A015	ActualActualUltimo	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours dans la période du coupon divisé par le nombre réel de jours de l'année. Cette méthode est une variante de la méthode ActualActualICMA, à l'exception du fait qu'elle suppose que l'échéance du coupon tombe toujours le dernier jour du mois. Méthode qui correspond à la méthode ACT/ACT.ISMA dans le modèle FpML et à la méthode Act/Act (ICMA Ultimo) dans le modèle FIX/FIXML.	10	Act/Act (ICMA Ultimo)	La méthode Act/Act (ICMA Ultimo) ne diffère de la méthode Act/Act (ICMA) que par le fait qu'elle suppose que l'échéance des coupons réguliers tombe toujours le dernier jour du mois. [Nom symbolique : ActActISMAUltimo]	ACT/ACT. ISMA	Le montant fixe/variable sera calculé conformément à la Règle 251 des statuts, règlements, règles et recommandations de l'International Capital Markets Association, comme publiés en avril 1999 et appliqués aux obligations classiques et convertibles émises après le 31 décembre 1998, comme si le montant fixe/variable était le coupon d'intérêt d'une telle obligation. Ce code de fractionnement du nombre de jours est applicable aux transactions comptabilisées conformément aux définitions de 2000 de l'ISDA. Les transactions effectuées aux termes des définitions de 2006 de l'ISDA doivent plutôt utiliser le code ACT/ACT.ISMA.

Valeur autori sée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXM L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
A016	IC30EPlus360	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Cette méthode est une variante de la méthode 30E360, à ceci près que si l'échéance du coupon tombe le dernier jour du mois, il faut remplacer la valeur de ce jour par « 1 » et augmenter de « 1 » la valeur du mois (c'est-à-dire passer au mois suivant). Cette méthode correspond à la méthode <u>ThirtyEPlusThreeSixty</u> du modèle FIX/FIXML.	13	30E+/360	Variante de la méthode 30E/360. Règles d'ajustement des dates : 1) si la Date1 tombe le 31 ^e jour du mois, il faut la remplacer par le 30; 2) si la Date2 tombe le 31 ^e jour du mois, il faut la remplacer par le 1 ^{er} et augmenter de « 1 » la valeur du Mois2 (Month2), c'est-à-dire passer au mois suivant. [Nom symbolique : ThirtyEPlusThreeSixty]		
A017	Actual364	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, divisé par 364. Cette méthode correspond à la méthode Act364 du modèle FIX/FIXML.	17	Act/364	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 364. [Nom symbolique : Act364]		
A018	Business252	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours ouvrables dans la période d'intérêt, divisé par 252. Usage : swaps de devises brésiliens. Cette méthode correspond à la méthode BUS/252 dans le modèle FpML et à la méthode BusTwoFiftyTwo dans le modèle FIX/FIXML.	12	BUS/252	Utilisé pour les swaps libellés en réal brésilien, qui sont basés sur les jours ouvrables au lieu des jours civils. Le nombre de jours ouvrables est divisé par 252. [Nom symbolique : BusTwoFiftyTwo]	BUS/252	Le nombre de jours ouvrables de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 252.
A019	Actual360NL	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, en excluant tout jour intercalaire du décompte, et d'une année de 360 jours.	16	NL360	Méthode identique à la méthode Act/360, à ceci près que les jours intercalaires (29 février) ne sont pas pris en compte. [Nom symbolique : NLThreeSixty]		
A020	1/1	Si les parties précisent que la base de calcul est 1/1, alors pour calculer le montant applicable, la valeur « 1 » est simplement introduite dans le calcul comme la base de calcul pertinente. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a).	0	1/1	Si les parties précisent que la base de calcul est 1/1, alors pour calculer le montant applicable, la valeur « 1 » est simplement introduite dans le calcul comme la base de calcul pertinente. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a). [Nom symbolique : OneOne]	1/1	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a).

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ⁷⁷	Valeur du code FIX/FIXML L ⁷⁸	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ⁷⁹	Définition FpML
NARR	Narrative	Autre méthode			Autres valeurs de code FIX/FIXML non énumérées ci-dessus et valeurs de code FIX/FIXML qui sont réservées aux extensions de l'utilisateur, dans la gamme des valeurs entières de 100 et plus.		

3.3 Méthode de valorisation

Classification des données de valorisation

Catégorie	Données utilisées	Méthode de valorisation ⁸¹
1	Prix cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques auxquels l'entité peut avoir accès à la date d'évaluation [IFRS 13:76/ASC 820-10-35-40]. Un prix coté sur un marché actif fournit la preuve la plus fiable de la juste valeur et est utilisé sans ajustement pour évaluer la juste valeur lorsqu'il est disponible, sauf pour quelques cas d'exception. [IFRS 13:77/ASC 820-10-35-41] Un marché actif est un marché sur lequel des transactions portant sur l'actif ou le passif ont lieu avec une fréquence et un volume suffisants pour fournir des informations sur les prix de manière continue. [IFRS 13 : Annexe A/ASC 820-10-20]	Valorisation au prix du marché
2	Prix cotés d'actifs ou de passifs similaires sur des marchés actifs [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-47] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation au prix du marché
3	Prix cotés d'actifs ou de passifs identiques ou similaires sur des marchés qui ne sont pas actifs [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(b)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation selon un modèle – les prix historiques provenant de marchés inactifs ne doivent pas être utilisés directement.
4	Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, par exemple les taux d'intérêt et les courbes de rendement observables à des intervalles de cotation courants, les volatilités implicites, les écarts de taux [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(c)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation au prix du marché
5	Les données qui sont principalement dérivées ou corroborées au moyen de données de marché observables par corrélation ou par d'autres moyens (« données corroborées par le marché ») [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(d)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation selon un modèle – les données peuvent être dérivées « principalement » de données de marché observables, ce qui signifie que des données non observables peuvent être utilisées.
6	Données non observables pour l'actif ou le passif. [IFRS 13:86/ASC 820-10-35-52] Les données non observables sont utilisées pour évaluer la juste valeur dans la mesure où des données observables pertinentes ne sont pas disponibles, ce qui permet de tenir compte des situations dans lesquelles le marché de l'actif ou du passif est peu actif, sinon inactif, à la date d'évaluation. Une entité développe des données non observables en utilisant les meilleures informations disponibles dans les	Valorisation selon un modèle – des données non observables sont utilisées

⁸¹ La classification fournie dans cette colonne est indépendante des normes IFRS 13 et ASC 820 et est utilisée dans le seul but de déclarer les éléments de données critiques des opérations sur dérivés de gré à gré.

circonstances, renseignements qui peuvent inclure les propres données de l'entité, en tenant compte de toutes les informations sur les hypothèses des participants au marché qui sont raisonnablement disponibles. [IFRS 13:87-89/ASC 820-10-35-53 - 35-54A]

3.4 Catégorie de sûreté

Valeur	Nom	Définition
UNCL	Sans sûreté	Il n'y a pas de convention de sûretés entre les contreparties ou la ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent qu'aucun dépôt de sûreté (ni marge initiale ni marge de variation) n'est requis en ce qui a trait à la transaction sur dérivé.
PRC1	Couverture partielle : contrepartie 1 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante ne dépose régulièrement qu'une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
PRC2	Couverture partielle : contrepartie 2 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie ne dépose régulièrement qu'une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
PRCL	Couverture partielle	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que les deux contreparties ne déposent régulièrement qu'une marge de variation au titre de la transaction sur dérivé.
OWC1	Couverture à sens unique : contrepartie 1 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
OWC2	Couverture à sens unique : contrepartie 2 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
OWP1	Couverture à sens unique/partielle : contrepartie 1	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose régulièrement qu'une marge de variation.
OWP2	Couverture à sens unique/partielle : contrepartie 2	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose régulièrement qu'une marge de variation.
FLCL	Couverture entière	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que les deux contreparties doivent effectuer le dépôt d'une marge initiale et déposer régulièrement une marge de variation au titre de la transaction sur dérivé.

3.5 Déclaration des actions et des événements

On trouve dans le tableau ci-dessous les combinaisons permises de [Type d'action] et de [Type d'événement]. Il y est aussi indiqué si elles s'appliquent au niveau de la transaction, au niveau de la position ou au deux. La dernière colonne du tableau permet de savoir, pour chaque [Type d'action], s'il peut être déclaré sans être accompagné d'un [Type d'événement].

Type d'événement

Type
d'action

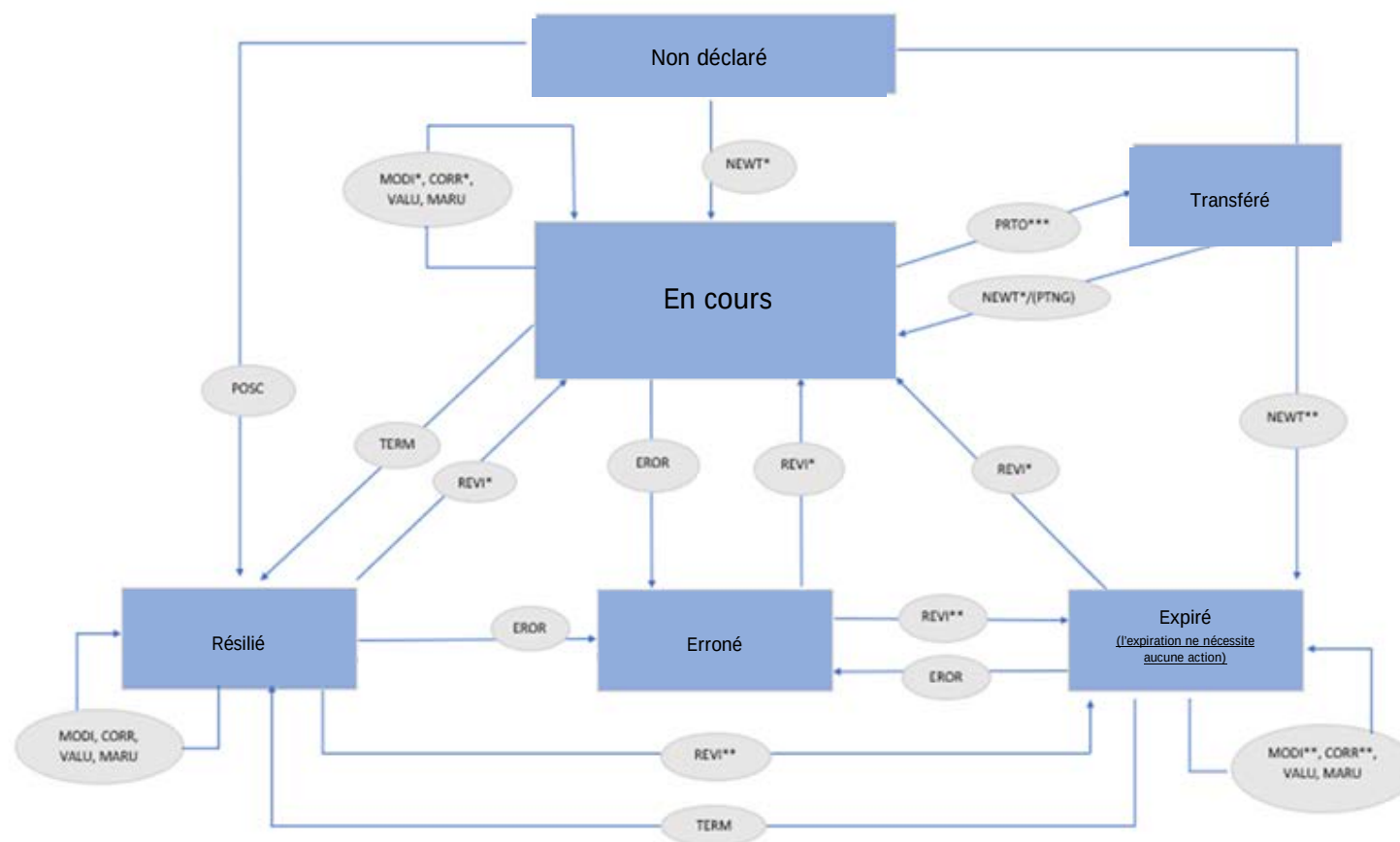
Combinaisons de Type d'action et de Type d'événement	Opération (TRAD)	Novation (NOVA)	Compression ou Mesure de réduction du risque (COMP)	Fin par anticipation (ETRM)	Compensation (CLRG)	Exercice (EXER)	Affectation (ALOC)	Compensation et affectation (CLAL)	Événement de crédit (CREV)	Transfert (PTNG)	Événement d'entreprise (CORP)	Mise à niveau (UPDT)	Inclusion dans une position (INCP)	Type d'événement non requis
Nouveau (NEWT)	O	O, P	O		O	O	O	O		O, P	O, P	O ⁸²	P	
Modifier (MODI)	O, P	O, P	O	P		O	O		O		O, P	O, P	P	P
Corriger (CORR)														O, P
Mettre fin (TERM)		O, P	O	O, P	O	O	O	O	O		O, P		O, P ⁸³	
Erreur (EROR)														O, P
Relancer (REVI)														O, P
Transférer (PRTO) ⁸⁴										O, P				
Valorisation (VALU)														O, P
Sûretés (MARU)														O, P
Élément de position (POSC)														O

⁸² NEWT-UPDT s'utilise pour la mise à niveau de swaps « exotiques », « complexes » ou « non génériques » de manière à ce que leur déclaration soit fidèle et conforme au *Manuel technique*.

⁸³ Un dérivé qui est ajouté à une position dès qu'il est négocié doit être déclaré au moyen du type d'action « POSC ». En revanche, un dérivé déclaré comme une nouvelle opération qui est ajouté plus tard à une position doit être déclaré au moyen du type d'action « TERM » et du type d'événement « INCP ».

⁸⁴ Toute opération active ou inactive (résiliée ou expirée) peut être transférée, sauf si elle a auparavant été déclarée comme une erreur. Une fois qu'une opération est déclarée comme « transférée » à un référentiel central, elle ne peut plus être transmise de nouveau à ce référentiel central, à moins d'être retransférée au même référentiel central. Il faut alors utiliser la combinaison « NEWT-PTNG ».

3.6 Séquence autorisée des actions du cycle de vie



Les combinaisons de type d'action et de type d'événement facilitent la présentation d'information. La séquence autorisée des actions du cycle de vie vise à éviter les transmissions illogiques. Une transmission pour laquelle le type d'action n'est pas possible compte tenu du type d'action précédent ne devrait pas satisfaire à la procédure de validation du référentiel central.

Notes : L'état du dérivé relancé dépend de la date d'échéance
 * date d'expiration >= aujourd'hui;
 ** date d'expiration < aujourd'hui.
 *** PRTO est aussi accepté (mais non souhaité) pour la résiliation ou l'expiration.

3.7 Définitions des valeurs autorisées pour les types d'événement

Type d'événement	Valeur autorisée	Définition
Opération	TRAD	Création ou modification d'une opération.
Novation/intervention	NOVA	Déplacement sur le plan juridique d'une partie ou de la totalité des risques financiers associés à une transaction, qui passent d'un cédant à un cessionnaire, ce qui a pour effet la fin ou la modification de la transaction initiale de manière à la résilier ou à en modifier le notionnel.
Mesure de réduction du risque postérieure à la transaction	COMP	Compression ou autre mesure de réduction du risque postérieure à l'opération, ayant généralement pour effet la fin ou la modification (c'est-à-dire la réduction de la valeur notionnelle) d'un ensemble de transactions existantes et la création d'un ensemble de transactions nouvelles, et aboutissant pour la contrepartie à une exposition au risque de marché largement identique à celle qui existait avant l'événement.
Fin par anticipation	ETRM	Fin d'une transaction existante avant sa date d'expiration.
Compensation	CLRG	Procédure (compensation centrale) suivant laquelle une contrepartie centrale s'interpose entre les contreparties aux transactions, devenant l'acheteur pour chaque vendeur et le vendeur pour chaque acheteur, garantissant ainsi l'exécution des transactions en cours et ayant pour effet de mettre fin à la transaction existante entre l'acheteur et le vendeur.
Exercice	EXER	Exercice complet ou partiel d'une option ou d'une swaption par l'une des contreparties à la transaction.
Affectation	ALOC	Procédure suivant laquelle des parties d'une transaction sont attribuées à une ou plusieurs autres contreparties et déclarées comme des transactions nouvelles ⁸⁵ .
Compensation et affectation	CLAL	Événement simultané de compensation et d'affectation par une contrepartie centrale.
Événement de crédit	CREV	Événement entraînant la modification ou la fin d'une transaction de crédit précédemment transmise. S'applique uniquement aux dérivés de crédit.
Transfert	PTNG	Procédure suivant laquelle une transaction est transférée à un autre référentiel central et ayant pour effet la clôture de la transaction dans un référentiel central et l'ouverture de la même transaction avec le même UTI dans un référentiel central différent (nouveau).
Inclusion dans la position	INCP	Inclusion d'une transaction compensée par une contrepartie centrale ou d'autres transactions fongibles dans une position à l'occasion de la résiliation d'une transaction existante et de la création d'une nouvelle position ou de la modification du notionnel de la position existante.
Événement d'entreprise	CORP	Processus par lequel une intervention d'entreprise à l'égard d'une action qui est un sous-jacent a une incidence sur les transactions portant sur cette action.
Mise à jour	UPDT	Mise à jour d'une transaction en cours en vue d'en assurer la conformité avec les obligations de déclaration modifiées.

⁸⁵ Lorsqu'un dérivé est conclu par un mandataire de contreparties et que l'opération est exécutée avant l'attribution du dérivé aux contreparties représentées par ce mandataire, nous préférons que la contrepartie déclarante ne déclare pas l'opération avant son attribution, mais attende de recevoir l'attribution de la part du mandataire et, une fois celle-ci traitée, déclare uniquement les dérivés attribués, à l'intérieur des intervalles de temps précisés au chapitre 31 des règlements sur la déclaration des opérations. Nous sommes néanmoins disposés à accepter la déclaration des opérations avant attribution de la manière décrite dans le *Manuel technique*; c'est pourquoi nous avons prévu « ALOC » comme valeur autorisée. Voir aussi l'exemple 4.4.

3.8 Définitions des valeurs autorisées pour les types d'action

Type d'action	Valeur autorisée	Définition
Nouveau	NEWT	Création de la première transaction donnant naissance à un nouvel UTI.
Modifier	MODI	Modification des modalités d'une transaction précédemment déclarée, en raison d'une modification nouvellement négociée ou l'ajout de renseignements qui n'étaient pas disponibles (par exemple dans le cas d'une transaction à tarification reportée), à l'exception de toute correction d'une transaction déclarée précédemment.
Corriger	CORR	Correction des données erronées d'une transaction déclarée précédemment.
Mettre fin	TERM	Résiliation d'une transaction déclarée précédemment.
Erreur	EROR	Annulation d'une transaction complète déclarée à tort, alors qu'elle n'a jamais pris naissance ou n'était pas soumise aux obligations de déclaration de la législation d'un territoire donné, ou annulation d'une déclaration en double.
Relancer	REVI	Action rétablissant une transaction déclarée avec le type d'action « Erreur », résiliée par erreur ou encore expirée en raison de la déclaration incorrecte de sa date d'expiration.
Valorisation	VALU	Mise à jour de la valorisation d'une transaction. Aucun type d'événement correspondant.
Mise à jour de sûreté/marge	MARU	Mise à jour des données sur les sûretés et les marges. Aucun type d'événement correspondant.
Élément de position	POSC	Déclaration d'une nouvelle transaction qui est incluse dans une déclaration de position distincte le même jour.
Transférer	PRT0	Transfert d'une transaction d'un référentiel central à un autre (changement de référentiel central).

3.9 Valeurs autorisées pour l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »

Pour un « identifiant de sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de suivre les instructions ci-dessous pour les valeurs autorisées mentionnées. Cette liste n'étant pas exhaustive, d'autres types pourraient y être ajoutés.

Catégorie d'actif	Type d'identifiant de sous-jacent	Forme de l'identifiant de sous-jacent si celui-ci ne figure pas dans la source de référence
Taux d'intérêt	Taux variable de référence	Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA
	Identifiant de titres de créance	S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser nom officiel de l'émetteur – date d'échéance – type d'intérêt – taux d'intérêt – fréquence de l'intérêt – rang des titres de créance
	Identifiant d'indice de titres de créance	Nom officiel complet du diffuseur de l'indice
	Indice d'inflation	Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA
Capitaux propres	Nom d'indice de titres de capitaux propres	Nom officiel complet du diffuseur de l'indice
	Identifiant de titres de capitaux propres	S'il n'y a pas de numéro ISIN (p. ex. dans le cas d'un titre non coté), utiliser nom officiel du titre – 2 ^e caractère de la CFI – 3 ^e caractère de la CFI
	Identifiant d'indice de titres de capitaux propres	Nom officiel complet du diffuseur de l'indice
Crédit	Identifiant de titre de créance	S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser nom officiel de l'émetteur – date d'échéance – type d'intérêt – taux d'intérêt – fréquence de l'intérêt – rang des titres de créance
	Identifiant d'indice de titres de créance	Nom officiel complet du diffuseur de l'indice
	Identifiant d'entité juridique autre qu'un LEI	Nom d'entité juridique tel qu'il serait consigné dans un registre LEI
Marchandises	Indice sur marchandises	Nom officiel complet du diffuseur de l'indice
	Prix de référence des marchandises	Nom du prix de référence des marchandises (CRP) – ISDA

Catégorie d'actif	Type d'identifiant de sous-jacent	Forme de l'identifiant de sous-jacent si celui-ci ne figure pas dans la source de référence
Autres	Contrat à terme négocié en bourse	S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser code d'identification de marché, code de produit de la place de négociation, contrat à terme de gré à gré et contrat à terme standardisé (F & F), AAAA-MM-JJ et 0
	Option négociée en bourse	S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser code d'identification de marché, code de produit de la place de négociation, option de vente/d'achat (O & P/C), AAAA-MM-JJ et prix d'exercice de l'option
	Actif numérique	Identifiant de jeton numérique ISO 24165

3.10 Valeurs autorisées pour la source de l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »

Pour une « source d'identifiant de sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de suivre les instructions ci-dessous pour les valeurs autorisées mentionnées. Cette liste n'étant pas exhaustive, d'autres types pourraient y être ajoutés.

Catégorie d'actif	Type d'identifiant de sous-jacent	Forme de la source de l'identifiant de sous-jacent
Taux d'intérêt	Taux variable de référence	Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA
	Identifiant de titres de créance	Nom et type des titres de créance selon le CDE
	Identifiant d'indice de titres de créance	Nom officiel du diffuseur
	Indice d'inflation	Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA
Capitaux propres	Nom d'indice de titres de capitaux propres	Nom officiel du diffuseur
	Identifiant de titres de capitaux propres	Nom et type de titre selon le CDE
	Identifiant d'indice de titres de capitaux propres	Nom officiel du diffuseur
Crédit	Identifiant de titres de créance	Nom et type de titre selon le CDE
	Identifiant d'indice de titres de créance	Nom officiel du diffuseur
	Identifiant d'entité juridique autre qu'un LEI	Nom de l'entité
Marchandises	Indice sur marchandises	Nom officiel du diffuseur
	Prix de référence des marchandises	Nom du prix de référence des marchandises (CRP) – ISDA
Autres	Contrat à terme négocié en bourse	Toutes formes
	Option négociée en bourse	Toutes formes
	Actif numérique	Identifiant de jeton numérique ISO 24165

4 Exemples

4.1 Transactions sur plateforme d'exécution de swaps – anonymes et compensées

Cet exemple illustre la déclaration de transactions anonymes qui sont compensées par la suite.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Horodatage de la réception pour compensation	Identifiant de l'initiateur	Contrepartie centrale	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2	Compensé	Identifiant de la plateforme
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	NULL	LEI1SEF0001	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
2	TERM	CLRG	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
3	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001BETA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI2CP0002	Y	NULL
4	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001GAMMA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1RPT0001	Y	NULL

4.2 Paquet – prix/écart

Cet exemple illustre la déclaration de paquet de dérivés fondée soit sur le prix soit sur l'écart.

Rangée 1 : transmission d'un nouveau paquet de dérivés alors que le prix du paquet de dérivés n'est pas encore connu.

Rangée 2 : modification du paquet de dérivés pour la mise à jour du prix du paquet de dérivés.

Rangée 3 : transmission d'un nouveau paquet de dérivés avec un écart de paquet de dérivés.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Indicateur de paquet de dérivés	Identifiant de paquet de dérivés	Prix du paquet de dérivés	Monnaie du prix du paquet de dérivés	Notation du prix du paquet de dérivés	Écart du paquet de dérivés	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	Notation de l'écart du paquet de dérivés	Prix	Monnaie du prix	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001EEE	Vrai	ABCD12	99999,999999999999	NULL	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	2023-04-05T16:14:36Z	LEI1RPT0001EEE	Vrai	ABCD12	3.2	CAD	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	Vrai	ABCD 34	NULL	NULL	NULL	200	NULL	4	20.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.3 Résiliation/modification partielle, correction

Cet exemple illustre l'utilisation de différentes combinaisons de types d'action et d'événement pour la déclaration de changements subis par une transaction déclarée précédemment.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Date d'expiration	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Type d'option incorporée	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	Vrai	2023-04-02T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	MODI	TRAD	Faux	2023-04-03T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		OPET	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
4	CORR			2023-04-04T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		EXTD	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.4 Affectation (ALOC)

Cet exemple illustre la déclaration des transactions d'affectation avant négociation et après négociation.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
2	TERM	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
3	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST1	LEI1RPT0001PREAA	4000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A1
4	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST2	LEI1RPT0001PREAA	6000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A2

4.5 Position

Cet exemple illustre la déclaration d'un dérivé à l'occasion de son inclusion dans une position.

Rangées 1 et 2 : déclaration d'un nouveau dérivé qui est à l'origine d'une nouvelle position le même jour (transaction d'achat).

Rangée 3 : transmission de messages de valorisation de fin de journée au niveau de la position.

Rangées 4, 5 et 6 : déclaration d'un nouveau dérivé inclus dans une position le même jour (transaction d'achat et de vente).

Rangées 7, 8, 9, 10 et 11 : déclaration d'un nouveau dérivé (autre façon de déclarer une opération) inclus dans une position le lendemain (transaction d'achat) (ce qui signifie que les messages de valorisation devront être envoyés à la fois pour LEI1RPT0001TRAD3 et LEI1RPT0001POSC1 le 8 janvier 2023).

Rangée 12 : depuis l'inclusion, le 9 janvier 2023, de l'identifiant LEI1RPT0001TRAD3 dans la position LEI1RPT0001POSC1, seul un message de valorisation doit être transmis pour la position LEI1RPT0001POSC1.

Rangée 13 : déclaration des transactions de vente devant être incluses dans la position LEI1RPT0001POSC1.

Rangée 14 : déclaration d'une fin par anticipation au niveau de la position en raison de transactions de vente.

Rangée 15 : transmission de messages de valorisation de fin de journée au niveau de la position.

Rangée 16 : déclaration des transactions de vente devant être incluses dans la position LEI1RPT0001POSC1.

Rangée 17 : fin d'une position.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	UTI	UTI de la position subséquente	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1	Contrepartie 2	Niveau	Identifiant de l'acheteur	Identifiant du vendeur	Montant de valorisation	Prix ⁸⁶
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	NEWT	INCP	2023-01-05T14:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
3	VALU		2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	1,68	
4	POSC		2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		13
5	POSC		2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001TRAD8	LEIRPT0001POSC1	100	2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13
6	MODI		2023-01-07T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12,333
7	NEWT	TRAD	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		14
8	VALU		2023-01-08T18:01:34Z	LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	23	
9	VALU		2023-01-08T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	65	
10	TERM	INCP	2023-01-09T18:02:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		14
11	MODI	INCP	2023-01-09T18:02:34Z	LEIRPT0001POSC1		2 200	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12,922
12	VALU		2023-01-09T18:03:34Z	LEIRPT0001POSC1		2 200	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	71,02	
13	POSC		2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001TRAD4	LEIRPT0001POSC1	1 200	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13,50
14	MODI	ETRM	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12,922
15	VALU		2023-01-10T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	78	
16	POSC		2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001TRAD5	LEIRPT0001POSC1	1 000	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13,75
17	TERM	ETRM	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

4.5a Position intrajournalière

Cet exemple illustre des opérations intrajournalières lorsque la position nette de fin de journée est de 0.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	UTI	UTI de la position subséquente	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1	Contrepartie 2	Niveau	Identifiant de l'acheteur	Identifiant du vendeur	Montant de valorisation	Prix ⁸⁷
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	POSC		2023-01-05T010:45:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	400	2023-01-05T010:45:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12,44
3	POSC		2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12,58
4	NEWT	INCP	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		0
5	TERM	ETRM	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

⁸⁶ Les valeurs de prix dans cet exemple sont données à titre indicatif seulement et varieront en fonction de la méthode de calcul utilisée.

⁸⁷ Ibid.

4.6 Erreur et relance

Cet exemple illustre le cas d'un dérivé comptabilisé par erreur, puis résilié, mais qui doit être relancé parce que résilié par erreur.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	EROR			2023-04-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	REVI			2023-04-05T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.7 Dérivé sur cryptoactifs

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 1	Indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 2	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Identifiant unique de produit	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD	Vrai	Faux	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG	QZ8VLPDHMT5	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.8 Mise à niveau

Cet exemple illustre la déclaration d'un événement de type « Mise à niveau », destiné à assurer la conformité avec des obligations de déclaration modifiées.

Rangée 1 : Exécution d'un nouveau dérivé le 2023-04-01.

Rangée 2 : Mise en application de nouvelles obligations de déclaration; déclaration du dérivé existant comme « Modifier-Mise à niveau » (MODI-UPDT) pour assurer la conformité aux nouvelles exigences⁸⁸.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Montant notionnel	Méthode de valorisation	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2	Identifiant de la plateforme	Compensé
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MarkToMarket	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	NULL	N
2	MODI	UPDT	2024-05-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MTMA	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	BILT	N

».

⁸⁸ Veuillez noter que l'exemple présenté ne constitue pas une liste exhaustive des champs touchés par les obligations de déclaration modifiées. Nous vous recommandons donc de consulter la règle pour connaître tous les champs qui peuvent être touchés.

Annexe B

Non applicable au Québec

Annexe C

Manuel technique des données sur les dérivés

Spécifications techniques concernant la déclaration des données sur les dérivés de gré à gré

25 juillet 2024

Le 11 août 2026

Version ~~1.0~~2.0

Historique du document

Révisions

<u>Date</u>	<u>Version</u>	<u>Description</u>
<u>2024-07-25</u>	<u>1.0</u>	<u>Première publication accompagnant des modifications des règlements sur la déclaration des opérations</u>
<u>2026-08-11</u>	<u>2.0</u>	<u>Seconde publication avec modifications</u>

Sommaire

1	INTRODUCTION	45
1.1	Contexte	45
1.1.1	Format des spécifications techniques	45
1.2	Explication de certains éléments de données ou catégories de données	67
1.2.1	Sens de la transaction	67
1.2.2	Éléments de données répétés ou produits à branches multiples	67
1.2.3	Tableaux	67
1.2.4	Événements du cycle de vie Actions et événements	68
1.2.5	Validations	78
1.2.6	Champs Identifiant unique de produit du sous-jacent (Autre)	79
1.2.7	Champs relatifs aux autres paiements	810
1.2.8	Paquets de dérivés	810
1.2.9	Déclaration des positions	810
1.2.10	UTI antérieur	811
1.3	Dérivés préalablement existants	911
2	SPÉCIFICATIONS TECHNIQUES	1012
2.1	Lignes directrices pour la déclaration des positions	5764
3	ANNEXE	6269
3.1	Montant notionnel	6269
3.2	Mise en correspondance des valeurs autorisées par la convention de calcul des jours avec les valeurs ISO 20022, FpML et FIX/FIXML	6370
3.3	Méthode de valorisation	7178
3.4	Catégorie de sûreté	7279
3.5	Déclaration des actions et des événements du cycle de vie	7279

3.6	Séquence autorisée des actions du cycle de vie	73 <u>81</u>
3.7	Définitions des valeurs autorisées pour les types d'événement	74 <u>82</u>
3.8	Définitions des valeurs autorisées pour les types d'action <u>d'action</u>	75 <u>83</u>
<u>3.9</u>	<u>Valeurs autorisées pour l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »</u>	<u>84</u>
<u>3.10</u>	<u>Valeurs autorisées pour la source de l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »</u>	<u>86</u>
 4	 EXEMPLES	 77 <u>87</u>
4.1	Transactions sur plateforme d'exécution de swaps – anonymes et compensées	77 <u>87</u>
4.2	Paquet – prix/écart	77 <u>87</u>
4.3	Résiliation/modification partielle, correction	78 <u>88</u>
4.4	Affectation (ALOC)	78 <u>88</u>
4.5	Position	78 <u>88</u>
<u>4.5a</u>	<u>Position intrajournalière</u>	<u>89</u>
4.6	Erreur et relance	79 <u>90</u>
4.7	Dérivé sur cryptoactifs	80 <u>90</u>
4.8	Mise à niveau	80 <u>90</u>

1 Introduction

1.1 Contexte

Le présent manuel (*Manuel technique des données sur les dérivés* des ACVM, appelé ci-après le **Manuel technique**) énonce les spécifications relatives à la définition, au format et aux valeurs autorisées pour chaque élément de données dont la déclaration est obligatoire en vertu de la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières du Manitoba, de la *Rule 91-507 Derivatives: Trade Reporting* de la Commission des valeurs mobilières de l'Ontario, du *Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés* du Québec et, dans les provinces et territoires non mentionnés ici, de la *Norme multilatérale 96-101 sur la déclaration des opérations sur dérivés* (collectivement appelés ci-après les **règlements sur la déclaration des opérations**). Ces spécifications sont principalement tirées du document *Revised CDE Technical Guidance – version 34: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*¹ (appelé ci-après les **orientations techniques CDE**).

Le *Manuel technique* est destiné à aider les intervenants sur le marché à déclarer leurs données conformément aux règlements sur la déclaration des opérations ~~dont l'entrée~~ qui sont entrés en vigueur ~~est attendue~~ pour le 25 juillet 2025.

À moins d'indication contraire dans le *Manuel technique* ou que la situation ne s'y prête pas, tout terme employé dans le *Manuel technique* et défini dans l'une ou l'autre des règlements sur la déclaration des opérations s'entend au sens de cette règle.

En général, lorsqu'un élément de données correspond aux prescriptions de la Commodity Futures Trading Commission (la **CFTC**), le *Manuel technique* emploie le même nom, la même définition, le même format et les mêmes valeurs autorisées que la CFTC.

Il est prévu que le *Manuel technique* soit périodiquement actualisé en fonction des mises à jour apportées par les Autorités canadiennes en valeurs mobilières (**ACVM**) et les instances internationales.

1.1.1 Format des spécifications techniques

- 1) **#** : un numéro est attribué à tous les éléments de données pour faciliter la consultation. Il est fait référence à ce numéro dans l'ensemble du *Manuel technique* et dans l'annexe A de chacun des règlements sur la déclaration des opérations.
- 2) **Source** : cette colonne contient la mention « CDE », « ACVM », « CFTC » ou « AEMF ». « CDE » indique un élément de données tiré des orientations techniques CDE, « CFTC », un élément de données provenant de la Commodity Futures Trading Commission et « AEMF », un élément de données provenant de l'Autorité européenne des marchés financiers.
- 3) **Catégorie** : les éléments de données sont regroupés par thème ou catégorie.
- 4) **Description de l'élément de données** : la brève description de l'élément de données qui est fournie dans l'annexe A de chacun des règlements sur la déclaration des opérations est reproduite dans le *Manuel technique* pour des raisons de commodité. Les descriptions sont rédigées de manière à respecter les normes de rédaction des règlements des ACVM tout en concordant en substance avec l'explication détaillée correspondante.
- 5) **Explication détaillée de l'élément de données** : pour les éléments de données « CDE », les explications proviennent des orientations techniques CDE, et des notes de bas de page ont été ajoutées pour donner des éclaircissements en fonction des règlements de la CFTC. Pour les éléments de données CFTC, les explications proviennent des spécifications techniques de la CFTC, et de notes de bas de page ont été ajoutées pour donner des éclaircissements. Pour les éléments de données « AEMF », les explications proviennent des règles de validation REFIT de l'AEMF. Les éléments de

¹ Voir *Revised CDE Technical Guidance – version 34 - Harmonisation of critical OTC derivative data elements (other than UTI and UPI)*, septembre 2023, https://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20230929.pdf décembre 2025, https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf.

données dont la source est la CFTC ou l'AEMF valent sans égard aux obligations de déclaration américaines ou européennes. Par exemple, les éléments de données de source CFTC ne valent pas uniquement pour les swaps visés par les règles de la CFTC, mais bien pour tous les dérivés devant être déclarés selon les règlements sur la déclaration des opérations, qu'ils le soient ou non selon les règles de la CFTC.

6) **Format** : voir le tableau ci-dessous pour la signification des formats utilisés dans le présent document.

Format	Contenu en bref	Explication complémentaire	Exemple(s)
AAAA-MM-JJ	Date	AAAA = quatre chiffres représentant l'année. MM = deux chiffres représentant le mois. JJ = deux chiffres représentant le jour.	2015-07-06 (Désigne le 6 juillet 2015)
AAAA-MM-JJThh:mm:ssZ	Date et heure	AAAA, MM, JJ comme ci-dessus. hh = deux chiffres représentant l'heure (00 à 23) (le format AM/PM n'est PAS autorisé). mm = deux chiffres représentant les minutes (00 à 59). ss = deux chiffres représentant les secondes (00 à 59). T est une constante et indique le début de l'élément « heure ». Z est une constante et indique que les heures sont exprimées en UTC (temps universel coordonné) et non en heure locale.	2014-11-05T13:15:30Z (désigne le 5 novembre 2014, 13 h 15 min 30 s, UTC, ou le 5 novembre 2014, 8 h 15 min 30 s, heure normale de l'est des États-Unis)
Num(25,5)	Jusqu'à 25 caractères numériques comprenant jusqu'à cinq décimales.	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à 25 caractères numériques, dont jusqu'à cinq caractères numériques après la virgule. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après la virgule, les contreparties déclarantes doivent arrondir à la moitié supérieure.	1352,67 12345678901234567890,12345 1234567890123456789012345 0 - 20000,25 - 0,257
Num(5) ²	Jusqu'à cinq caractères numériques; les décimales ne sont pas autorisées.	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à cinq caractères numériques	12345 123 20
Char(3)	Trois caractères alphanumériques	La longueur est fixée à trois caractères alphanumériques.	USD X1X 999
Varchar(25)	Jusqu'à 25 caractères alphanumériques	La longueur n'est pas fixe, mais elle est limitée à 25 caractères alphanumériques. Aucun caractère spécial n'est autorisé. S'ils sont autorisés, cela sera explicitement indiqué dans le format de l'élément de données.	asgaGEH3268EFdsagtTRCF543 aaaaaaaaa x
Booléen	Caractères booléens	« Vrai » ou « Faux » ou encore « vrai » ou « faux » ³	Vrai/vrai Faux/faux

Tableau 1 – Explication des formats utilisés dans les spécifications techniques

² Le format Num(5) est équivalent au format Num(5,0) utilisé dans le présent manuel, mais ne permet pas l'emploi de décimales.

³ Les majuscules comme les minuscules sont acceptées tant que les ACVM n'ont pas adopté la norme de messagerie ISO 20022.

1.2 Explication de certains éléments de données ou catégories de données

1.2.1 Sens de la transaction

Le *Manuel technique* exige la déclaration de l'acheteur/du vendeur ou du payeur/du receveur pour cet élément de données. Il s'agit d'une approche légèrement différente de celle des orientations techniques CDE, qui prévoient deux options de déclaration du sens de la transaction. La contrepartie déclarante n'a pas à déclarer à la fois l'acheteur/le vendeur et le payeur/le receveur pour une transaction donnée; elle emploie la méthode de déclaration appropriée au type d'instrument déclaré.

1.2.2 Éléments de données répétés ou produits à branches multiples

Un produit à branches ou flux multiples pourrait être déclaré plus d'une fois au moyen d'un même élément de données; cela dépend du produit déclaré et de la convention de marché qui s'y rattache. Pour qu'un produit puisse être déclaré plus d'une fois au moyen d'un même élément de données, il doit être coté à titre de branche. Si le concept de branches ou flux multiples ne s'applique pas au produit, déclarer les valeurs dans l'élément de données correspondant à la première branche (branche 1) pour tous les champs spécifiés comme se rapportant aux produits à branches multiples. Pour les produits comportant deux branches dont l'une fait référence à une valeur fixe et l'autre, à une valeur variable, les éléments relatifs à la branche 1 doivent concerner la branche qui fait référence à la valeur fixe et les éléments relatifs à la branche 2 doivent concerner la branche qui fait référence à la valeur variable. Pour les produits comportant deux branches faisant référence chacune à une valeur variable différente, l'ordre des branches doit correspondre à l'ordre alphabétique de leurs sous-jacents respectifs. Si les sous-jacents en question portent un même nom, mais se différencient par leur durée, les éléments relatifs à la branche 1 doivent concerner le sous-jacent qui a la durée la plus courte.

1.2.3 Tableaux

Les données relatives aux dérivés auxquels sont associés des tableaux ~~spécifiant des renseignements connus au moment de l'exécution de la transaction~~ doivent être déclarées en tant que données à communiquer à l'exécution si les renseignements sont connus au moment de l'exécution de la transaction, ou dans le cadre d'un événement du cycle de vie lorsque les valeurs en question deviennent connues pendant la durée de vie de la transaction. Lorsque plusieurs valeurs doivent être déclarées dans un même champ, il est possible de placer un délimiteur entre ces valeurs. Le choix du délimiteur est laissé à la discrétion du référentiel central, mais ce même délimiteur doit être ~~le même pour tous les champs. Les champs qui permettent l'inscription de multiples valeurs sont tous d'une longueur variable d'un maximum de 500 caractères pour ce qui est du type de donnée, quelle que soit la forme sous laquelle le référentiel central collecte les~~ utilisé de façon uniforme dans tous les fichiers. Le format et les valeurs permises qui figurent dans le tableau 2 s'appliquent à chaque valeur individuelle au sein d'un champ de tableau plutôt qu'au champ délimité. Chaque entrée doit, de façon indépendante, respecter le format et les règles de validation applicables à l'élément de données.

Les champs de ~~ses participants~~ tableau doivent contenir le même nombre d'entrées dans tous les champs connexes, et les entrées doivent être placées en ordre chronologique de date de prise d'effet. La diffusion publique est obligatoire pour les 10 premières valeurs des champs de tableau.

De multiples valeurs peuvent être déclarées à l'égard des éléments de données suivants :

- | | | |
|---|---|---|
| • 10 Territoire de la contrepartie 1 | • 51 Tableau de prix – date de fin | • 126 Nombre d'unités des composantes du panier |
| • 11 Territoire de la contrepartie 2 | • 52 Tableau de prix – prix | • 127 Unité de mesure des composantes du panier |
| • 37 Tableau de la quantité notionnelle – date de prise d'effet | • 65 Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet | • 136 Montant de l'autre paiement |
| • 38 Tableau de la quantité notionnelle – date de fin | • 66 Tableau de prix d'exercice – date de fin | • 137 Monnaie de l'autre paiement |
| • 39 Tableau de la quantité notionnelle – quantité notionnelle | • 67 Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice | • 138 Date de l'autre paiement |
| • 40 Tableau de montants notionnels – montant notionnel | • 77 Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1 | • 139 Payeur de l'autre paiement |
| • 41 Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet | • 78 Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2 | • 140 Receveur de l'autre paiement |
| • 42 Tableau de montants notionnels – date de fin | • 124 Identifiant des composantes du panier | • 141 Type de l'autre paiement |
| • 50 Tableau de prix – date de prise d'effet | • 125 Source de l'identifiant des composantes du panier | |

1.2.4 Actions et événements

L'Annexe 3.5 montre comment présenter les différents événements dans les déclarations de transactions, de positions et de fin de journée (valorisation et sûretés) ~~est illustrée sous la rubrique 3.5.~~

Il faut au moins déclarer tout élément de données touché par des actions ou des événements. Il revient au référentiel central de juger de la pertinence d'inclure d'autres éléments dans les messages qui se rapportent aux événements.

Les corrections portant sur la valorisation et les sûretés sont permises. Elles doivent être déclarées au moyen des types d'action « VALU » et « MARU ».

1.2.5 Validations

De manière générale, les validations sont censées être les mêmes que celles prévues par la CFTC dans ses obligations de déclaration des données à la Partie 45 dans le cas où l'élément de données du *Manuel technique* serait également requis par la CFTC. Il est loisible au référentiel central de limiter le nombre d'éléments de données à transmettre pour les types d'action « TERM », « PRTO » et « EROR ».

Types de déclarations

Transaction = données à communiquer à l'exécution et données sur les événements du cycle de vie. On entend par « transaction » la conclusion, la cession, la vente ou toute autre forme d'acquisition ou d'aliénation d'un dérivé ou la novation d'un dérivé. D'après les règlements sur la déclaration des opérations, chaque transaction est à déclarer comme un dérivé unique.

Valorisation = données de valorisation. On entend par « données de valorisation » les données qui indiquent la valeur actuelle du dérivé et qui comprennent les données visées dans les éléments de la rubrique «Éléments de données relatifs à la valorisation» de l'annexe A.

Sûretés = données sur les marges. On entend par « données sur les sûretés et les marges » les données correspondant aux montants actuels de sûreté et de marge déposées ou collectées qui sont visés dans les éléments de la rubrique « Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges » de l'annexe.

Valeurs

O = obligatoire (L'élément de données est obligatoire et les règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées, doivent aussi être suivies.)

C = conditionnel (L'élément de données est requis si les conditions énoncées dans les règles de validation sont réunies. Les règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées, doivent aussi être suivies.)

NR = non requis (L'élément de données n'est pas requis dans la déclaration.)

F = facultatif (L'élément de données est à ~~inclure~~déclarer ~~s'il est pertinent~~s'applique au dérivé. Son utilisation peut être soumise à l'application de règles de validation supplémentaires, s'il en est de spécifiées.)

Exemple :

« Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon (champ vide) » signifie

Transaction – C (conditionnel) :

Ce champ est O (obligatoire) si à la fois le champ [Identifiant du payeur] et le champ [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés. Sinon, le laisser vide.

« Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon (facultatif) » signifie

Transaction – C (conditionnel) :

Ce champ est O (obligatoire) si à la fois le champ [Identifiant du payeur] et le champ [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés. Autrement, le champ est F (facultatif) (c.-à-d. qu'il peut être inclus s'il est applicable au dérivé).

Éléments de données par branche

~~Les validations contenues dans le Manuel technique en ce qui concerne les éléments~~Si un élément de données ~~par~~est à branches multiples et que le tableau 2 ne contient pas de validations propres à chaque branche ~~sont censées, les validations visent à~~ s'appliquer par défaut à la première branche (branche 1). On ne peut présumer qu'elles s'appliquent ~~de la même manière~~ à la seconde branche (branche 2), en grande partie en raison de la conditionnalité qui existe entre les champs qui concernent les branches et du fait que les éléments de données propres à un référentiel central peuvent ~~exercer~~avoir sur ~~l'application~~le fonctionnement des validations publiées des effets qui ne sont pas prévus dans le *Manuel technique*. C'est pourquoi les référentiels centraux peuvent incorporer ~~d'autres~~des validations supplémentaires à l'égard des éléments de données par branche ~~s'ils~~lorsqu'ils l'estiment nécessaire.

~~Il est possible d'inscrire une valeur lorsque l'instruction « sinon » est « (champ vide) », ce qui s'interprète comme un « sinon » optionnel.~~

1.2.6 Champs Identifiant unique de produit du sous-jacent (Autre)

Éléments de données relatifs à l'actif sous-jacent

Les éléments de données de cette série servent à communiquer les informations relatives aux sous-jacents lorsqu'elles ne peuvent être dérivées de l'UPI. Ces éléments de données s'appliquent aux actifs de toute catégorie et doivent être fournis à l'appui de tout sous-jacent.

- Les éléments de données 128 et 129 sont à utiliser/déclarer lorsque le fournisseur de services UPI ne reçoit/prend pas en charge d'identifiant ni de source pour un sous-jacent en particulier ~~(c'est-à-dire que, dans ces cas, la valeur transmise au affectée par l'initiateur ou le fournisseur de services UPI pour les aux~~ champs « Identifiant du sous-jacent » et « Source de l'identifiant du sous-jacent » ou à leurs attributs équivalents est « AUTRE » ~~dans les deux cas~~. Voici des indications sur les valeurs pouvant être utilisées :
 - o Identifiants de sous-jacent qui ne proviennent pas de la source de référence : Dans le cas d'un identifiant de sous-jacent ou d'une source d'identifiant de sous-jacent qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de se reporter aux tableaux 9 et 10 de l'Annexe afin de connaître les valeurs autorisées prédéfinies; la liste n'est pas exhaustive et d'autres types pourraient être inclus.
 - o Identifiants de sous-jacent provenant de la source de référence mais ne figurant pas encore dans la liste d'énumération du fournisseur de services UPI : Dans le cas d'un identifiant de sous-jacent qui se trouve dans la source de référence mais ne figure pas encore dans la liste d'énumération du fournisseur de services UPI (en raison d'un délai entre la création d'un nouvel identifiant de sous-jacent dans la source de référence et son ajout à la liste en question), la valeur autorisée devrait être celle qui paraît dans la source de référence.
- Les éléments de données 130 et 131 sont nécessaires à la détermination du prix d'un actif ou indice sous-jacent qui ne peut être dérivé de l'UPI.
- L'élément de données 121 sert à faciliter le repérage des transactions sur dérivés fondées sur des cryptoactifs lorsqu'il n'est pas possible de le faire d'après l'UPI.

1.2.7 Champs relatifs aux autres paiements

Les éléments de données de la série qui concerne les autres paiements peuvent être déclarés plusieurs fois dans le cas de multiples paiements. Si les autres paiements sont faits par versements, il convient de déclarer le calendrier des paiements dans son intégralité.

1.2.8 Paquets de dérivés

Lorsqu'un paquet de dérivés est constitué d'une combinaison de contrats dérivés négociés ensemble en tant que produit d'une seule entente économique et que le tableau des champs ne permet pas de fournir tous les renseignements dans une seule déclaration, la contrepartie déclarante ou l'entité chargée de la déclaration se sert de l'identifiant de paquet de dérivés comme unique lien entre les déclarations relatives à un même contrat dérivé.

Si un dérivé cesse d'exister, mais donne naissance à un autre dérivé, ces deux contrats sont à déclarer individuellement et non comme un paquet de dérivés. Il ne convient donc pas de lier leurs déclarations au moyen d'un identifiant de paquet de dérivés, mais il faut utiliser le champ « UTI antérieur ».

Les champs de déclaration « Prix du paquet de dérivés » et « Monnaie du prix du paquet de dérivés » doivent contenir le prix et la monnaie qui s'applique au paquet de dérivés dans sa totalité et non ceux de ses composants. Si les composants ont des prix individuels, il faut inscrire ces prix et leur monnaie dans les champs « Prix » et « Monnaie du prix » des déclarations pertinentes en plus d'utiliser le « Prix du paquet de dérivés ».

1.2.9 Déclaration des positions

La déclaration des positions est une méthode facultative de déclaration des dérivés qui est conforme aux obligations énoncées à l'article 33.1 des règlements sur la déclaration des opérations. La manière de déclarer les événements du cycle de vie en lien avec certains éléments de données est précisée sous la rubrique 2.1, « Lignes directrices pour la déclaration des positions ». La déclaration des événements du cycle de vie au niveau des positions est possible pour tous les éléments de données pertinents lorsque le dérivé répond aux conditions énoncées. Pour un exemple, voir la rubrique 4.5.

La déclaration des positions n'est possible que si les dérivés ont d'abord été déclarés séparément au niveau des transactions. L'état des dérivés doit être mis à jour au niveau des transactions de manière à ce qu'il soit évident que les dérivés ne sont plus ouverts et ainsi prévenir la double déclaration des dérivés inclus dans les positions. La contrepartie déclarante doit déclarer au niveau des transactions la fin de tout dérivé

qui entre dans une position. Pour les nouveaux dérivés inclus dans la position le même jour, elle utilise le type d'action « POSC » sans type d'événement. Pour les dérivés inclus dans la position un autre jour, elle utilise le type d'action « TERM » et le type d'événement « INCP ».

Lorsque la valorisation d'une position devient nulle, il n'y a que deux façons possibles de procéder :

- Mettre fin à la position et déclarer ultérieurement une nouvelle position au moyen d'un UTI différent. Ne déclarer aucune valorisation entre la fin de la première position et la création de la nouvelle.
- Garder la position ouverte et déclarer quotidiennement une valeur nulle.

1.2.10 UTI antérieur

L'UTI antérieur doit être attribué au dérivé qui est le prédécesseur de celui auquel il a donné naissance en raison d'un événement du cycle de vie, lorsque la relation entre les dérivés est d'un à un. Cet élément de données ne s'utilise pas lorsque la relation entre les dérivés est de plusieurs à un ou de plusieurs à plusieurs (par exemple dans le cas d'une compression). Il s'utilise particulièrement à l'occasion des événements suivants :

- Novation complète ou partielle (déclaration avec le type d'action « NEWT » et le type d'événement « NOVA », inclusion de l'UTI antérieur);
- Compensation;
- Exercice (dans le cas des swaptions);
- Répartition (déclaration avec le type d'action « NEWT » et le type d'événement « ALOC », inclusion de l'UTI antérieur);

~~e. Événement d'entreprise (dans le cas d'un fractionnement).~~

1.3 Dérivés préalablement existants

Les contreparties ne doivent pas créer de nouveaux UTI pour les dérivés en cours, même si l'UTI d'origine n'est pas entièrement conforme, par exemple, avec les nouveaux formats prescrits par le *Manuel technique*. Dans le cas des IUS (identifiants uniques de swap) utilisés pour des dérivés existants, le référentiel central peut permettre que ces IUS soient transmis comme éléments de données distincts.

Tous les dérivés existants devront ultimement être mis à niveau en fonction des nouvelles exigences et déclarés au moyen du type d'action « Modifier » (MODI) et du type d'événement « Mise à niveau » (UPDT).

2 Spécifications techniques

Éléments de données relatifs aux contreparties

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
1	CDE	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Identifiant de la contrepartie déclarante	L'identifiant de la contrepartie à une transaction sur dérivé de gré à gré⁴ qui remplit son obligation de déclaration par la déclaration en question. Dans les territoires où les deux parties doivent déclarer la transaction, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie toujours la contrepartie déclarante. Dans le cas d'une transaction sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie. Ce gestionnaire peut toutefois être déclaré en tant que contrepartie si l'attribution de l'opération de bloc à des fonds particuliers n'a pas encore eu lieu avant la date limite de déclaration. Lorsque l'obligation de déclaration est acquittée par une plateforme de négociation, l'identifiant de la contrepartie 1 identifie l'une des contreparties à la transaction.	Char(20) pour un code LEI	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
2	CDE	Contrepartie 2 (contrepartie non déclarante)	Identifiant de la contrepartie non déclarante	L'identifiant de la deuxième contrepartie⁵ à une transaction sur dérivé de gré à gré. Dans le cas d'une transaction sur dérivés attribuée qu'un gestionnaire de fonds exécute pour le compte d'un fonds, c'est le fonds, et non pas le gestionnaire, qui est déclaré en tant que contrepartie. Ce gestionnaire peut toutefois être déclaré en tant que contrepartie si l'attribution de l'opération de bloc à des fonds particuliers n'a pas encore eu lieu avant la date limite de déclaration.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O

⁴ Dans les explications des éléments de données du CDE et les annexes du *Manuel technique*, les expressions « dérivé de gré à gré » et « opération » s'entendent d'un dérivé.

⁵ On ne doit déclarer qu'une seule contrepartie. Si plusieurs contreparties se partagent la responsabilité en droit incombant à la seconde contrepartie (par exemple, sont responsables solidairement), ne déclarer qu'une seule de ces contreparties et toujours utiliser cette même contrepartie pour la déclaration des données de continuité et des événements du cycle de vie.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
3	EFTCC DE	Source de l'identifiant de la contrepartie 2	Type d'identifiant de la contrepartie 2.	La source servant à identifier la contrepartie 2.	Char(4)	• LEID = identifiant pour les entités juridiques • NPID = identifiant de personne physique, pour identifier les personnes qui agissent en tant que particuliers, et (non en tant qu'entités commerciales admissible à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale)). • PLID = un identifiant interne seulement si : 1) la contrepartie 2 est soumise à une loi de blocage ou à une exigence de consentement; 2) l'autorité de réglementation compétente membre des ACVM a rendu une décision de dispense relativement aux lois de blocage et exigences de consentement; et 3) la contrepartie déclarante est en conformité avec les conditions de la décision de dispense.	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
4	CDE	Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur.	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}; lorsqu'ils sont utilisés, <u>Lorsqu'ils sont utilisés :</u> la la valeur doit correspondre à la valeur <u>soit</u> de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou, <u>soit de</u> [Contrepartie 2]; la la valeur ne doit pas correspondre à la valeur de [Identifiant du vendeur]. Sûretés – NR Valorisation – NR
5	CDE	Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur.	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un identifiant interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie	N	Transaction – C si [Identifiant du payeur] et [Identifiant du receveur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}; lorsqu'ils sont utilisés, <u>Lorsqu'ils sont utilisés :</u> la la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou <u>de</u> [Contrepartie 2];

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.		déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.		- la valeur ne doit pas correspondre à la valeur de [Identifiant de l'acheteur]. Sûretés – NR Valorisation – NR
6	CDE	Identifiant du payeur [Identifiant du payeur – branche 1] [Identifiant du payeur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur.	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt ⁶ , les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un identifiant interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration.	N	Transaction – C si [Identifiant de l'acheteur] et [Identifiant du vendeur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}; lorsqu'ils . <u>Lorsqu'ils</u> sont utilisés, la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou de [Contrepartie 2]. Sûretés – NR Valorisation – NR
7	CDE	Identifiant du receveur [Identifiant du receveur – branche 1] [Identifiant du receveur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse.	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt ⁷ , les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la	N	Transaction – C si [Identifiant de l'acheteur] et [Identifiant du vendeur] ne sont pas utilisés, sinon {champ vide}; lorsqu'ils . <u>Lorsqu'ils</u> sont utilisés, la valeur doit correspondre à la valeur de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] ou de [Contrepartie 2]. Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶ Dans un swap fixe variable, le payeur est la contrepartie qui paie le taux fixe.⁷ Dans un swap fixe variable, le receveur est la contrepartie qui reçoit le taux fixe.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.		contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration.		
8	ESMA	Identifiant du courtier ⁸	Identifiant d'un courtier qui agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie.	Lorsque le courtier agit comme intermédiaire pour la contrepartie 1 sans devenir lui-même une contrepartie, la contrepartie 1 doit désigner ce courtier par un identifiant pour les entités juridiques.	Char(20)	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org).	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
9	ACVM	Pays et province ou territoire de la personne physique (contrepartie non déclarante)	Si la personne physique est une contrepartie non déclarante, le pays de résidence de celle-ci et, si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	Si la contrepartie non déclarante est une personne physique, le pays de résidence de celle-ci et, si elle réside au Canada, la province ou le territoire.	CharVarchar(5)	Toute valeur valide selon la norme ISO 3166-2 si la résidence de la personne physique est au Canada; sinon, utiliser la norme ISO 3166 pour le pays de résidence de la personne physique.	N	Transaction – F Transaction – C si [Source de l'identifiant de la contrepartie 2] = NPID, sinon (facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
10	ACVM	Territoire de la contrepartie 1	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 1 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada;	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 1 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, si la contrepartie non déclarante est une personne physique résidant dans le territoire en question, et/ou - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> (chapitre I-14.01, r. 1.1) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (chapitre I-14.01)⁹.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	N	Transaction – O Sûretés – NRQ Valorisation – NRQ

⁸ En anglais, le nom de cet élément de données selon l'ESMA est « Broker ID » (au lieu de « Broker identifier » selon le *Manuel technique*).

⁹ Une liste des personnes agréées se trouve à l'adresse <https://lautorite.qc.ca/professionnels/valeurs-mobilieres-et-derivees/encadrement-des-marches-des-derivees-au-quebec>.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
			territoire du Canada, uniquement si la contrepartie non déclarante est une personne physique résidant dans le territoire en question, et/ou une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> (chapitre I-14.01, r. 1.1) qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i> (chapitre I-14.01).					
11	ACVM	Territoire de la contrepartie 2	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 2 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada; - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i>.	Chaque territoire dans lequel la contrepartie 2 est : - une contrepartie locale conformément au paragraphe a ou c de la définition de cette expression dans les règlements sur la déclaration des données sur les dérivés de tout territoire du Canada, et/ou - une contrepartie locale conformément au paragraphe b de la définition de cette expression dans le <i>Règlement 91-507 sur les référentiels centraux et la déclaration de données sur les dérivés</i> qui est une personne agréée en vertu de l'article 82 de la <i>Loi sur les instruments dérivés</i>.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	À déterminer par le référentiel central désigné/reconnu, de concert avec les ACVM.	N	Transaction – O Sûretés – NRQ Valorisation – NRQ

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations

Éléments de données relatifs aux dérivés

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
12	CDE	Date d'entrée en vigueur ¹⁴⁸	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé entrent en vigueur.	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré entrent en vigueur. <u>Liste non exhaustive d'exemples :</u> <u>Pour les swaps sur défaillance sur un indice de crédit, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat (soit habituellement un jour ou deux après la date d'exécution), et non la date de report de position de l'indice sous-jacent.</u> <u>Pour les contrats de garantie de taux, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat, et non la date de règlement.</u> <u>Pour les options et les swaptions, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat, et non celle du sous-jacent.</u> <u>Pour les swaps de taux d'intérêt différés, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du contrat (appelée date de début différée dans le contrat).</u> <u>Pour les contrats dont la confirmation n'inclut pas de date d'entrée en vigueur, s'ils sont déclarés, la date d'entrée en vigueur qui débute immédiatement devrait être celle qui figure dans la partie « date » de l'horodatage de l'exécution.</u>	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR

¹⁴⁸ Pour les swaps de marchandises, déclarer la date de début des prix.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				Pour les nouveaux contrats découlant d'événements du cycle de vie, la date d'entrée en vigueur devrait être celle de l'entrée en vigueur du nouveau contrat.				
13	CDE	Date d'expiration ¹⁴⁹	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives au dérivé cessent d'avoir effet.	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré cessent d'avoir effet. Cet élément n'est pas modifié s'il est mis fin à la transaction par anticipation.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – C si l'UPI [Retour ou paiement] n'est pas un contrat sur différence (CFD), sinon (champ vide facultatif). Lorsque cet élément est utilisé, la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Date d'entrée en vigueur] <u>ou à la partie « date » de [Horodatage de l'exécution]</u> . Sûretés – NR Valorisation – NR
14	CDE	Horodatage de l'exécution	La date et l'heure de l'exécution de la transaction.	La date et l'heure de l'exécution initiale de la transaction ayant généré un nouvel UTI. Cet élément demeure inchangé pendant la durée de validité de l'UTI ¹⁵⁰ .	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC ¹⁵¹ . Si l'élément temporel n'est pas requis dans une province, un territoire ou un État en particulier, l'heure peut être omise étant donné que, dans le cas de représentations à précision réduite, la norme ISO 8601 permet d'omettre des éléments de la représentation de la date/heure, l'omission commençant par l'extrême droite (dans l'ordre, à partir de l'élément le moins significatif).	Toute date/heure valide <u>basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601</u> .	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
15	CDE	Horodatage de la déclaration ¹⁵²	La date et l'heure de soumission de la déclaration au référentiel central.	La date et l'heure auxquelles la déclaration est effectivement transmise au référentiel central.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC.	Toute date/heure valide <u>basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601</u> .	N	Transaction – O; la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Horodatage de l'exécution] Sûretés – O Valorisation – O

¹⁴⁹ Pour les swaps de marchandises, déclarer la date de fin des prix.¹⁵⁰ Pour les dérivés compensés, l'horodatage de l'exécution est la date et l'heure auxquelles la chambre de compensation accepte le dérivé d'origine pour compensation.¹⁵¹ La déclaration doit inclure la partie date et la partie heure.¹⁵² L'horodatage de la déclaration (#15) est exécuté et déclaré par l'initiateur.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
16	CDE	Identifiant unique de transaction (UTI)	L'identifiant unique qui identifie un dérivé ou une position pendant tout son cycle de vie.	L'identifiant unique attribué à la transaction ou à la position qui sert à les identifier de manière unique pendant tout leur cycle de vie dans l'ensemble des dossiers et déclarations.	Varchar(52)	Identifiant unique de transaction ISO 23897, jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Les nouveaux UTI doivent être construits uniquement à partir des lettres majuscules de A à Z ou des chiffres de 0 à 9 inclusivement. L'UTI est constitué du LEI de l'entité qui le crée et d'un code alphanumérique unique.	N	Transaction – O Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] = « TRANSACTION-LEVEL », sinon {champ vide} Valorisation – O
17	CDE	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'UTI attribué à un dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	L'UTI attribué à la transaction antérieure ayant donné lieu à la transaction déclarée en raison d'un événement du cycle de vie dans une relation entre les transactions qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'une transaction est résiliée et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou lorsqu'une transaction est scindée en plusieurs différentes). Cet élément de données ne s'applique pas lors de la déclaration de relations de plusieurs à une et de plusieurs à plusieurs entre des transactions (par exemple, dans le cas d'une compression).	Varchar(52)	Identifiant unique de transaction ISO 23897, jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Les nouveaux UTI doivent être construits uniquement à partir des lettres majuscules de A à Z ou des chiffres de 0 à 9, inclusivement.	N	Transaction – C si [Type d'action] = « NEWT » et si ([Type d'événement] = « NOVAT NOVA » ou « CLRG » ou « EXER » ou « ALOC » ou « CLAL ») et si [UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)] n'est pas utilisé, sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
18	ESMA	UTI de la position subséquente	L'UTI de la position dans laquelle le dérivé est inclus.	L'UTI de la position dans laquelle le dérivé est inclus. Ce champ ne s'applique qu'aux déclarations relatives à la fin d'une transaction sur dérivé du fait de son inclusion dans une position.	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques. Seuls les lettres majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés.	Lettres majuscules A-Z et chiffres 0-9 autorisés	N	Transaction – C si ([Type d'action] = « POSC » ou ([Type d'action] = « TERM » et [Type d'événement] = « INCP »), sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
19	CFTC	USI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	L'identifiant unique de swap (USI) attribué au dérivé avant la survenance d'un événement du cycle de vie ayant donné lieu au dérivé actuel.	L'identifiant unique de swap (USI) attribué à la transaction antérieure ayant donné lieu à la transaction déclarée en raison d'un événement du cycle de vie, dans une relation entre les transactions qui est d'une à une (par exemple, dans le cas d'une novation, lorsqu'il est mis fin à une transaction et qu'une nouvelle est générée) ou d'une à plusieurs (par exemple, lors de la compensation ou lorsqu'une transaction est scindée en plusieurs différentes). Cet élément de données ne s'applique pas lors de la déclaration de relations de plusieurs à une et de plusieurs à plusieurs entre des transactions (par exemple, dans le cas d'une compression).	Varchar(42)	Se reporter à : CFTC USI Data Standard Jusqu'à 42 caractères alphanumériques	N	Transaction – C si [Type d'action] = « NEWT » et si ([Type d'événement] = « NOVAT NOVA » ou « CLRG » ou « EXER » ou « ALOC » ou « CLAL ») et si [UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)] n'est pas utilisé, sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
20	ACVM	Indicateur intragroupe	L'indication que le dérivé est conclu ou non entre deux entités du même groupe.	Indique si le dérivé est conclu entre deux entités du même groupe.	Booléen	• VRAI<u>Vrai</u> = contrat conclu dans le cadre d'une transaction intragroupe • FAUX<u>Faux</u> = contrat non conclu dans le cadre d'une transaction intragroupe	N	Transaction – O <u>Transaction – C si [Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme] = « Faux » et [Compensé] = « N », sinon [facultatif]</u> Sûretés – NR Valorisation – NR
21	CFTCC <u>DE</u>	Identifiant de l'initiateur	L'identifiant de l'entité soumettant les données sur les dérivés au référentiel central.	L'identifiant de l'entité transmettant les données la transaction sur dérivé de gré à gré au référentiel central de swaps¹⁵. Cet identifiant est le même que celui¹⁶. <u>En cas de la contrepartie déclarante ou de la plateforme d'exécution de swaps¹⁶, à moins que ceux-ci aient recours à un tiers fournisseur de services pour la transmission des données au référentiel central, auquel cas il convient de déclarer l'identifiant à déclarer est celui de ce tiers fournisseur de services.</u>	Char(20)	Code LEI <u>ISO 17442</u> qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – O Sûretés – O Valorisation – O
22	CDE	Identifiant de la plateforme	L'identifiant de la plateforme de négociation sur laquelle la transaction a été exécutée.	L'identifiant de la plateforme de négociation (par exemple, une bourse, une plateforme de négociation multilatérale, une plateforme d'exécution de swaps) sur laquelle la transaction a été exécutée.	Char(4)	Code d'identification de marché (MIC) de segment ISO 10383 ^{17,18} . Si aucun système de négociation n'a été utilisé pour la transaction : • XOFF pour les transactions portant sur des instruments cotés; • XXXX pour les transactions portant sur des instruments non cotés; • BILT si la contrepartie déclarante n'est pas en mesure de déterminer d'après les obligations imposées par les autorités compétentes si l'instrument est coté ou non.	O	Transaction – C si [Compensé] = « N » ou « I », NR si [Compensé] = « Y » <u>sinon [facultatif]</u> Sûretés – NR Valorisation – NR
23	ACVM	Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme	L'indication que la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme de négociation.	Indique si la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme de négociation.	Booléen	• Vrai = la transaction a été exécutée anonymement sur une plateforme • Faux = la transaction n'a pas été exécutée anonymement sur une plateforme ou sans objet	N	Transaction – O ¹⁴ Sûretés – NR Valorisation – NR

¹⁵ Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « référentiel central de swaps » (expression abrégée en anglais par « SDR ») s'entend d'un référentiel central désigné/reconnu.

¹⁶ Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « plateforme d'exécution de swaps » (expression abrégée en anglais par « SEF ») s'entend d'une plateforme de négociation de dérivés.

^{17,18} S'il n'existe pas de MIC de segment, utiliser le MIC d'exploitation.

¹⁴ L'élément de données 23 est obligatoire pour les transactions exécutées sur une plateforme de négociation.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
24	ESMA	Type d'accord-cadre	Type d'accord-cadre.	Mention du type d'accord-cadre selon lequel les contreparties ont conclu un dérivé.	Char(4)	• « ISDA » – ISDA • « CDEA » – Accord d'exécution de produits dérivés compensés FIA-ISDA • « EUMA » – Accord-cadre européen • « FPCA » – Accord de clientèle professionnelle de la FOA • « FMAT » – Accord-cadre de la FBF concernant des transactions portant sur des instruments financiers pour contrat à terme de gré à gré • « DERV » – Accord-cadre allemand concernant les transactions portant sur des instruments financiers pour contrat à terme de gré à gré (DRV) • « CMOP » – Accord-cadre pour les transactions financières • « CHMA » – Accord-cadre suisse • « IDMA » – Accord-cadre sur les produits dérivés islamiques • « EFMA » – Accord-cadre de l'EFET • « GMRA » – Accord-cadre mondial de rachat • « GMSL » – Accord-cadre mondial de prêt de valeurs mobilières • « BIAG » – Accord bilatéral • Ou « OTHR » <u>si-le-pour-les-swaps-compensés-ou-toute-autre-transaction-sur-dérivé-qui-n'est-pas-couverte-par-un-type-d'accord-cadre-ou-pour-laquelle-l'accord-cadre-applicable-ne-figure-pas-dans-la-liste-ci-dessus-précédente.</u>	N	Transaction – O <u>Transaction – C si [Indicateur d'exécution anonyme sur une plateforme] = Faux, sinon (facultatif)</u> Sûretés – NR Valorisation – NR
25	ESMA	Version de l'accord-cadre	Année de la version de l'accord-cadre.	Mention de l'année de l'accord-cadre (p. ex. 1992, 2002) s'appliquant, le cas échéant, au dérivé déclaré.	AAAA	Date ISO 8601 en format AAAA	N	Transaction – C si [Type d'accord-cadre] <u>est-utilisé-pour-une-valeur-différente-de-« BIAG » ou de « OTHR », ce-champ-ci-doit-être-utilisé-null, sinon (facultatif)</u> Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux montants et quantités notionnels

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
26	CDE	Montant notionnel ¹⁴⁹ [montant notionnel – branche 1] [montant notionnel – branche 2]	Montant notionnel à l'égard de chaque branche d'un dérivé : • si le dérivé est négocié en montant monétaire, le montant qui y est stipulé; • si le dérivé est négocié en montant non monétaire, le convertir en montant monétaire.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : - pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires, le montant stipulé dans le contrat; - pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires, se reporter à l'annexe 3.1 pour la conversion des montants notionnels en des montants non monétaires. • Pour les transactions sur dérivés de gré à gré prévoyant un tableau de montants notionnels, le montant déclaré sous cet élément de données est le montant notionnel initial convenu par les contreparties au début de la transaction; • pour les options sur devises de gré à gré, outre cet élément de données, les montants sont déclarés au moyen des éléments de données Montant d'achat et Montant de vente; • pour les modifications ou les événements du cycle de vie ¹⁵⁰ , on déclare le montant notionnel en cours qui en résulte (les réalisations des étapes des tableaux des montants notionnels ne sont pas considérées comme des modifications ou des événements du cycle de vie); • si le montant notionnel est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu.	Num(25,5)	Toute valeur (les valeurs négatives ne sont permises que lorsqu'elles s'appliquent à un dérivé sur marchandises, p. ex. pour la prise en compte du coût de stockage) ¹⁵¹ .	0	Transaction – FX – O si UPI.[Type d'instrument] = « Option », la valeur devra correspondre à celle de [Montant d'achat] ou de [Montant de vente] Transaction – GR/FX/GO/IEQ – O Sûretés – NR Valorisation – NR
27	CDE	Monnaie notionnelle [monnaie notionnelle – branche 1] [monnaie notionnelle – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, la monnaie dans laquelle le montant notionnel est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	0	Transaction – O si UPI.[Type d'instrument] = « Option », la valeur devra correspondre à celle de [Monnaie d'achat] ou de [Monnaie de vente] Sûretés – NR Transaction – [Monnaie notionnelle – branche 1] C si [Monnaie notionnelle – branche 1] est utilisé, sinon (facultatif). [Monnaie notionnelle – branche 2] C si [Monnaie notionnelle – branche 2] est utilisé, sinon (facultatif). Sûretés – NR Valorisation – NR

¹⁴⁹ Pour les swaps sur défaillance de crédit, il s'agit du montant brut et non du montant net après incrément de version dû à un événement de crédit.¹⁵⁰ Si l'événement du cycle de vie est une résiliation complète avant la date d'échéance, la pleine valeur résiliée est à déclarer dans l'élément de données Montant notionnel.¹⁵¹ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « 999999999999999999999999 » (25 caractères numériques, décimales comprises).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
28	CDE	Montant d'achat	Montant monétaire qu'une personne a le droit d'acheter en vertu d'une option.	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – FX – C si UPI. [Type d'instrument] = « Option » <u>et UPI</u> . <u>[Produit] ≠ « Option numérique »</u> , au moins un de ces éléments est requis : ([Montant d'achat] ou [Montant de vente]), <u>sinon (facultatif)</u> . Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
29	CDE	Monnaie d'achat	Monnaie du montant d'achat d'une option.	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant d'achat est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – FX – C si [Montant d'achat] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
30	CDE	Montant de vente	Montant monétaire qu'une personne a le droit de vendre en vertu d'une option.	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit de vendre.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – FX – C si UPI. [Type d'instrument] = « Option » <u>et UPI</u> . <u>[Produit] ≠ « Option numérique »</u> , au moins un de ces éléments est requis : ([Montant d'achat] ou [Montant de vente]), <u>sinon (facultatif)</u> . Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
31	CDE	Monnaie de vente	Monnaie du montant de vente d'une option.	Pour les options sur devises, la monnaie dans laquelle le Montant de vente est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – FX – C si [Montant de vente] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
32	CFTC	Quantité notionnelle [quantité notionnelle – branche 1] [quantité notionnelle – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé négocié en montant non monétaire, la quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau.	À l'égard de chaque branche d'une transaction de swap ²¹⁻¹⁸ , s'il y a lieu, relativement aux transactions de swap négociées en montants non monétaires, quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau (par exemple, 50 barils par mois). La fréquence est déclarée dans la Fréquence de cotation de la quantité, et l'unité de mesure l'est dans l'Unité de mesure de la quantité.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO – F Lorsque le champ est utilisé, la valeur doit être inférieure ou égale à la valeur du champ [Quantité notionnelle totale]. Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
33	CFTC	Fréquence de cotation de la quantité ²²⁻¹⁹ [fréquence de cotation de la quantité – branche 1] [fréquence de cotation de la quantité – branche 2]	Période pour laquelle la quantité est cotée.	À l'égard de chaque branche d'une transaction de swap, s'il y a lieu, la cadence à laquelle la quantité est cotée à l'égard de la transaction (par exemple aux heures, quotidiennement, hebdomadairement ou mensuellement).	Char(4)	• HOUL = Horaire • DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • ONDE = Sur demande • YEAR = Annuelle • EXPI = Fin du contrat • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers)	N	Transaction – CO [Fréquence de cotation de la quantité – branche 1] – C si [Quantité notionnelle – branche 1] est utilisée, sinon (champ vide) [Fréquence de cotation de la quantité – branche 2] – C si [Quantité notionnelle – branche 2] est utilisée, sinon (champ vide) Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
34	CFTC	Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur [fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 1] [fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 2]	Nombre de périodes de fréquence de cotation de la quantité.	À l'égard de chaque branche de la transaction de swap, s'il y a lieu, le nombre d'unités de temps de la fréquence de cotation de la quantité.	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 1] – C si [Fréquence de cotation de la quantité – branche 1] ≠ « ONDE » ou « ADHO », sinon (champ vide facultatif) [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur – branche 2] – C si [Fréquence de cotation de la quantité – branche 2] ≠

²¹⁻¹⁸ Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « swap » et « opération de swap » s'entendent d'un dérivé.

²²⁻¹⁹ Pour représenter une fréquence trimestrielle, déclarer [Fréquence de cotation de la quantité] = « MNTH » et [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur] = « 3 ». Pour une fréquence semestrielle, déclarer [Fréquence de cotation de la quantité] = « MNTH » et [Fréquence de cotation de la quantité – multiplicateur] = « 6 ».

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								« ONDE » ou « ADHO », sinon (facultatif) Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
35	CDE	Unité de mesure de la quantité [unité de mesure de la quantité – branche 1] [unité de mesure de la quantité – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de mesure de la quantité notionnelle totale et de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : l'unité de mesure dans laquelle la Quantité notionnelle totale et la Quantité notionnelle sont exprimées.	CharVarchar(4)	Jeu de codes d'unités de mesure ISO 20022 ou autre jeu de codes d'UDM approuvé pour la DD	N	Transaction – EQ/CO – O Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
36	CDE	Quantité notionnelle totale [quantité notionnelle totale – branche 1] [quantité notionnelle totale – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la quantité notionnelle globale de l'élément sous-jacent pendant la durée du dérivé.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la Quantité notionnelle globale de l'actif sous-jacent pendant la durée de la transaction. Lorsque la Quantité notionnelle totale est inconnue au moment de la déclaration de la nouvelle transaction, elle doit être mise à jour dès qu'elle est connue.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro ²³²⁰ .	N	Transaction – EQ/CO – O Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
37	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée [date de prise d'effet de la quantité notionnelle – branche 1] [date de prise d'effet de la quantité notionnelle – branche 2]	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau : - la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants non monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : La date non ajustée de prise d'effet de la quantité notionnelle associée La quantité notionnelle initiale et les dates Montant notionnel initial – date de prise d'effet et de fin non ajustées correspondantes sont à déclarer déclarée en tant que premières valeurs première valeur du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CO – C si [Tableau de quantités notionnelles – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon (champ vide) Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de quantité notionnelle. Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

²³²⁰ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « 99999999999999999999999999999999 » (25 caractères numériques, décimales comprises).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
38	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – date de fin non ajustée de la quantité notionnelle [date de fin de la quantité notionnelle – branche 1] [date de fin de la quantité notionnelle – branche 2]	Pour chaque quantité notionnelle indiquée dans le tableau : - la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) de la quantité notionnelle.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : La quantité notionnelle initiale et les dates de prise d'effet et de la date de fin non ajustée de la quantité notionnelle (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date d'effet non ajustée de la période subséquente) <u>La date de fin non ajustées correspondantes sont à déclarer en tant que premières valeurs figurant au tableau de la quantité notionnelle initiale est déclarée en tant que première valeur</u> du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CO – C si [Tableau de quantités notionnelles – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon (champ vide) <u>Transaction – CO – F</u> <u>Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de quantité notionnelle si ce champ est utilisé.</u> <u>Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR</u> Sûretés – NR Valorisation – NR
39	CDE	Tableau de la quantité notionnelle – quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée [quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 1] [quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 2]	Chaque quantité notionnelle, indiquée dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 37 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 38.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de quantités notionnelles : • La quantité notionnelle qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée. La quantité notionnelle <u>figurant au tableau de la quantité notionnelle initiale et les dates de prise d'effet et de fin non ajustées correspondantes sont à déclarer</u> est déclarée en tant que premières valeurs <u>première valeur</u> du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les quantités notionnelles dépendent d'une condition ou d'un événement. L'unité de mesure de la quantité pour les différentes quantités notionnelles dans le tableau est indiquée par la valeur Unité de mesure de la quantité.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – CO – F <u>Le nombre de valeurs de quantité notionnelle doit évaluer le nombre d'intervalles de date.</u> Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
40	CDE	Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée [montant notionnel en vigueur à la date de	Chaque montant notionnel, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 41 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 42.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : • Le montant notionnel qui prend effet à la date de prise d'effet non ajustée associée. Le montant notionnel <u>figurant au tableau du montant notionnel initial et les dates de prise d'effet et de fin non ajustées correspondantes</u>	Num(25,5)	Toute valeur établie selon ISO 20022 : Derivative/Notional/CurrencyAndAmount	N	Transaction – IR – C si UPI, [Tableau des montants notionnels] ≠ « Constant », sinon (champ vide facultatif) Le nombre de valeurs de montant notionnel doit évaluer le nombre

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
		prise d'effet associée – branche 1] [montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée – branche 2]		sont déclarés <u>est déclaré</u> en tant que premières valeurs <u>première valeur</u> du tableau. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.				d'intervalles entre date de début et date de fin. Transaction – CR/FX/CO/EQ – F Sûretés – NR Valorisation – NR
41	CDE	Tableau de montants notionnels – date de prise d'effet non ajustée du montant notionnel [date de prise d'effet du montant notionnel – branche 1] [date de prise d'effet du montant notionnel – branche 2]	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau : la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : La <u>La</u> date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend effet. <u>La date de prise d'effet figurant au tableau de montants notionnels est déclarée en tant que première valeur du tableau.</u> Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon {champ vide} Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de montant notionnel. Sûretés – NR Valorisation – NR
42	CDE	Tableau de montants notionnels – date de fin non ajustée du montant notionnel [date de fin du montant notionnel – branche 1] [date de fin du montant notionnel – branche 2]	Pour chaque montant notionnel indiqué dans un tableau : la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du montant notionnel.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires prévoyant un tableau de montants notionnels : La <u>La</u> date non ajustée à laquelle le montant notionnel associé prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date d'effet non ajustée de la période subséquente). <u>La date de fin figurant au tableau de montants notionnels est déclarée en tant que première valeur du tableau.</u> Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré dont les montants notionnels dépendent d'une condition ou d'un événement. La monnaie des différents montants notionnels dans le tableau est indiquée par la valeur Monnaie notionnelle.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de montants notionnels – montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon {champ vide} <u>Transaction – F</u> Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de montant notionnel <u>si le champ est utilisé</u> . Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux prix

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
43	CDE	Taux de change ²⁴²¹	Le taux de change des deux monnaies du dérivé.	Le taux de change des deux monnaies de la transaction sur dérivé de gré à gré dont les contreparties ont convenu au début de la transaction, exprimé en taux de conversion de l'unité monétaire en monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. Le taux de change à déclarer est le taux de change à terme.	Num(18,13)	Toute valeur supérieure à zéro.	N	Transaction – FX – O C si UPI, [Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {facultatif} Transaction – IR/FX/CO/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
44	CDE	Base du taux de change [base du taux de change – branche 1] [base du taux de change – branche 2]	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé.	La paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le taux de change est libellé. Cet élément est exprimé en unité monétaire/monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR.	Char(3)/Char(3); [unité monétaire/monnaie cotée], sans restreindre l'ordre de la paire de monnaies (c'est-à-dire que la base du taux de change peut être USD/EUR ou EUR/USD).	Toute paire de monnaies incluse dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – FX – O Transaction – IR/CR/CO/EQ – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
45	CDE	Taux fixe [taux fixe – branche 1] [taux fixe – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé prévoyant des paiements périodiques, le taux annuel de la branche fixe.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques, le taux annuel de la ou des branches fixes.	Nul (11,10)	Valeurs positives et négatives exprimées en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %)	O	Transaction – CR – C si [Écart] n'est pas utilisé et [Type d'autre paiement] ≠ « UFRO » et UPI, [Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – IR C si [Écart] n'est pas utilisé et UPI, [Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – CO C si [Prix] ou [Écart] n'est pas utilisé et UPI, [Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – FX/EQ – NRE Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁴²¹ Pour les opérations sur devises, il s'agit du taux de change à terme.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
46	CDE	Prix ²⁵ ²²	Le prix indiqué dans le dérivé.	Le prix spécifié de la transaction sur dérivé de gré à gré, les frais, droits, taxes et commissions étant exclus. Pour les swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et les produits semblables²⁶²³ avec paiements périodiques, cet élément de données renvoie au prix fixe de la ou des branches fixes. Pour les contrats à terme de gré à gré sur marchandises et sur actions et les produits semblables, il renvoie au prix à terme de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les contrats sur différence et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent. Cet élément de données ne s'applique pas dans les cas suivants : • Les swaps de taux d'intérêt et les contrats de garantie de taux de gré à gré, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe et Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur taux d'intérêt et les swaptions sur taux d'intérêt, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les swaps de référence sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans l'élément de données Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les swaps, contrats à terme de gré à gré et contrats d'option sur devises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux de change, Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur actions, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les swaps sur défaillance et les swaps sur rendement total de crédit, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe, Écart et Paiement forfaitaire unique (Type d'autre paiement : Paiement forfaitaire unique) peuvent être interprétés comme le prix de la transaction; • Les options sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction.	• Num(18,13) si la Notation du prix = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix = 3	• N'importe quelle valeur si la Notation du prix = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix = 3	0	Transaction – EQ – C si [Écart] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {champ vide{facultatif} Transaction – CO C si ([Taux fixe] ou [Écart] n'est pas utilisé) et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon {champ vide{facultatif} Transaction – IR/FX/CR – NRE Sûretés – NR Valorisation – NR

²⁵²² Le Prix (#46) rend compte du prix auquel les parties ont négocié le contrat, tandis que le prix pratiqué sur le marché est représenté par le montant de la valorisation.

²⁶²³ Dans les explications des éléments de données du CDE, « produit » s'entend d'un dérivé.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				Si le prix est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu. Pour les transactions qui font partie d'un paquet, cet élément de données contient le prix de la transaction qui en est une composante, le cas échéant.				
47	CDE	Monnaie du prix	La monnaie dans laquelle le prix est libellé.	La monnaie dans laquelle le prix est libellé. La monnaie du prix ne s'applique que si la Notation du prix = 1.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – EQ/CO – C si [Notation du prix] = « 1 », sinon {champ vide} Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
48	CDE	Notation du prix	La manière dont le prix est exprimé.	La manière dont le prix est exprimé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	O	Transaction – EQ/CO – C si [Prix] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
49	CDE	Unité de mesure du prix	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	L'unité de mesure dans laquelle le prix est exprimé.	Char <u>Varchar</u> (4)	Jeu de codes d'unités de mesure ISO 20022 ou autre jeu de codes d'UDM approuvé pour la DD	N	Transaction – EQ/CO – C si [Prix] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
50	CDE	Tableau de prix – date de prise d'effet non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • La date de prise d'effet non ajustée du prix. Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – EQ/CO – C si [Tableau de prix – prix] est utilisé, sinon {champ vide} <u>Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de prix.</u> Transaction – CR/IR/FX – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Sûretés – NR Valorisation – NR
51	CDE	Tableau de prix – date de fin non ajustée du prix	Pour chaque prix indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • la date non ajustée à laquelle le prix prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date de prise d'effet non ajustée de la période subséquente). Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – EQ/CO – C si [Tableau de prix – prix] est utilisé, sinon (champ vide) Transaction – CR/IR/FX – NR Transaction – F <u>Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de prix si le champ est utilisé.</u> Sûretés – NR Valorisation – NR
52	CDE	Tableau de prix – prix	Chaque prix, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 50 jusqu'à celle stipulée dans l'élément de données 51.	Pour les transactions sur dérivé de gré à gré dont le prix varie pendant la durée de la transaction : • Le prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. La monnaie, la notation et l'unité de mesure des prix variables figurant dans le tableau sont à déclarer respectivement dans les éléments de donnée Monnaie du prix, Notation du prix et Unité de mesure du prix.	• Num(18,13) si la Notation du prix = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix = 3	• N'importe quelle valeur supérieure à zéro, si la Notation du prix = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix = 3	N	Transaction – EQ – C si [Prix] ou [Écart] n'est pas utilisé et UPL[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon (champ vide facultatif) Transaction – CO C si ([Prix], [Taux fixe] ou [Écart] n'est pas utilisé) et UPL[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon (champ vide facultatif) <u>Le nombre de valeurs de prix doit évaluer le nombre d'intervalles de date de début.</u> Transaction – CR/IR/FX – NRE Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
53	CDE	Écart ^{27,24} [écart – branche 1] [écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'écart précisé sur le prix de référence.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu. Pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques (par exemple, swaps fixe-variable, swaps variable-variable, swaps sur marchandises) : • soit, lorsqu'il existe un écart pour une ou plusieurs branches variables, l'écart sur le prix établi par référence à un indice de la ou des branches variables (par exemple, USD-LIBOR-BBA plus 0,03 ou WTI moins 14,65 USD) • soit la différence entre les prix établis par référence à un indice de chacune des branches variables (par exemple, l'écart de 9,00 USD pour un swap de référence WCS-WTI lorsque le WCS est évalué à 43 USD et le WTI à 52 USD).	• Num(18,13) si la Notation de l'écart = 1 • Num(11,10) si la Notation de l'écart = 3 • Num(5) si la Notation de l'écart = 4	• N'importe quelle valeur si la Notation de l'écart = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart = 3 • N'importe quel nombre entier exprimé en points de base (par exemple, 257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart = 4	0	Transaction – CR – C si [Taux fixe] n'est pas utilisé et [Type d'autre paiement] ≠ « UFRO » et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – IR C si [Taux fixe] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – EQ – C si [Prix] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – CO C si [Prix] ou [Taux fixe] n'est pas utilisé et UPI.[Type d'instrument] ≠ « Option », sinon { champ vide facultatif} Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
54	CDE	Monnaie de l'écart [monnaie de l'écart – branche 1] [monnaie de l'écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la monnaie dans laquelle l'écart est libellé.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la monnaie dans laquelle l'écart est libellé. Cet élément de données ne s'applique que si la Notation de l'écart = 1.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	0	Transaction – CR/IR/EQ/CO [Monnaie de l'écart – branche 1] C si [Notation de l'écart – branche 1] = « 1 », sinon {champ vide} Transaction – FX – NR [Monnaie de l'écart – branche 2] C si [Notation de l'écart – branche 2] = « 1 », sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR

^{27,24} Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les contrats sur différence, déclarer l'écart moyen pondéré pour le panier et non pour chacune des branches.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
55	CDE	Notation de l'écart [écartnotation de l'écart – branche 1] [écartnotation de l'écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la manière dont est exprimé l'écart.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la manière dont est exprimé l'écart.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales • 4 = Points de base	O	Transaction – CR/IR/EQ/CO [Notation de l'écart – branche 1] C si [Écart – branche 1] est utilisé, sinon {champ vide} [Notation de l'écart – branche 2] C si [Écart – branche 2] est utilisé, sinon {champ vide} Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
56	CDE	Prix d'exercice	Pour le dérivé qui est une option, le prix auquel son titulaire peut acheter ou vendre l'élément sous-jacent.	• Pour les options autres que celles sur devises^{28 25}, les swaptions et les produits semblables, le prix auquel le titulaire de l'option peut acheter ou vendre l'actif sous-jacent. • Pour les options sur devises, le taux de change auquel l'option peut être exercée, exprimé en taux de conversion de l'unité monétaire en monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. - Si le prix d'exercice est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu; • Pour les swaps de volatilité et de variance et les produits semblables, la volatilité/variance d'exercice.	• Num(18,13) si la Notation du prix d'exercice = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 3	• Toute valeur (par exemple, 6,39 USD)- exprimée sous la forme 6,39, pour les options sur actions, les options sur marchandises, les options sur devises et les produits semblables, si la Notation du prix d'exercice = 1. • Toute valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,021 au lieu de 2,1 %) pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart, et les produits semblables, si la Notation du prix d'exercice = 3.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon (champ videfacultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
57	CDE	Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies	Monnaie ou la paire et l'ordre des monnaies dans lesquels le prix d'exercice est libellé.	Pour les options sur actions, les options sur marchandises et les produits semblables, la monnaie dans laquelle le prix d'exercice est libellé. Pour les options sur devises : la paire et l'ordre des monnaies dans lesquelles le prix d'exercice est libellé. Le prix d'exercice s'exprime en unité monétaire/monnaie cotée. Dans l'exemple 0,9426 USD/EUR, USD est l'unité monétaire et EUR est la monnaie cotée; 1 USD = 0,9426 EUR. L'élément Monnaie du prix d'exercice/de la paire de monnaies ne s'applique que si la Notation du prix d'exercice = 1.	• Char(3) • Pour les options sur devises : Char(3)/Char(3); [unité monétaire/monnaie cotée] sans restreindre l'ordre de la paire de monnaies (c'est-à-dire que la paire de monnaies du prix d'exercice peut être USD/EUR ou EUR/USD).	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix d'exercice] = « 1 », sinon (champ videfacultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
58	CDE	Notation du prix d'exercice	Manière dont le prix d'exercice est exprimé.	La manière dont le prix d'exercice est exprimé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	O	Transaction – C si [Prix d'exercice] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR

^{28 25} Dans le texte anglais des explications des éléments de données du CDE, « FX » s'entend des devises et du change.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
59	CDE	Date de prise d'effet non ajustée du prix	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Date de prise d'effet non ajustée du prix [Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC. [Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601. [Sans objet : doublon de l'élément de données 50]	N	Transaction – C si [Tableau de prix – prix en vigueur entre les dates de prise d'effet et de fin non ajustées] est utilisé, sinon (champ vide) Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 50]
60	CDE	Date de fin non ajustée du prix	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix.	Date de fin non ajustée du prix (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date d'effet non ajustée de la période subséquente) [Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC. [Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601. [Sans objet : doublon de l'élément de données 51]	N	Transaction – C si [Tableau de prix – prix en vigueur entre les dates de prise d'effet et de fin non ajustées] est utilisé, sinon (champ vide) Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 51]
61	CDE	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée	Prix en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 59 et celle stipulée dans l'élément de données 60.	Le prix en vigueur de la date de prise d'effet non ajustée à la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix ne s'applique que si le prix varie suivant le tableau en question. [Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	• Num(18,13) si la Notation du prix = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix = 3 [Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	• N'importe quelle valeur supérieure à zéro, si la Notation du prix = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %) si la Notation du prix = 3 [Sans objet : doublon de l'élément de données 52]	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 52]
62	CDE	Date de prise d'effet du prix d'exercice	La date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	La date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice. [Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC. [Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601. [Sans objet : doublon de l'élément de données 65]	N	Transaction – C si [Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon (champ vide) Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 65]

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
63	CDE	Date de fin du prix d'exercice	La date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	La date non ajustée à laquelle le prix prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date de prise d'effet non ajustée de la période subséquente). [Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC. [Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601. [Sans objet : doublon de l'élément de données 66]	N	Transaction – C si [Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée] est utilisé, sinon (champ vide) Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 66]
64	CDE	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	Prix d'exercice en vigueur à compter de la date indiquée dans l'élément de données 62 et celle stipulée dans l'élément de données 63.	Le prix d'exercice en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. [Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	• Num(18,13) si la Notation du prix d'exercice = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 2 • Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 3 [Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	N'importe quelle valeur supérieure à zéro : • Pour les options sur actions, les options sur marchandises, les options sur devises et les produits semblables, toute valeur (par exemple, 6,39 USD) exprimée sous la forme 6,39, si la Notation du prix d'exercice = 1; • Pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart et les produits semblables, toute valeur exprimée sous forme de pourcentage (par exemple, 2,1 au lieu de 2,1 %), si la Notation du prix d'exercice = 2; • Pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart et les produits semblables, toute valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,021 au lieu de 2,1 %), si la Notation du prix d'exercice = 3. [Sans objet : doublon de l'élément de données 67]	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR [Sans objet : doublon de l'élément de données 67]
65	CDE	Tableau de prix d'exercice – date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de prise d'effet (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : • La date de prise d'effet non ajustée du prix d'exercice. Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice] est utilisé, sinon (champ vide) <u>Le nombre de valeurs de date doit évaluer le nombre de valeurs de prix d'exercice.</u> Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
66	CDE	Tableau de prix d'exercice – date de fin non ajustée du prix d'exercice	Pour chaque prix d'exercice indiqué dans un tableau, la date de fin (non ajustée pour la convention relative aux jours ouvrables) du prix d'exercice.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : La date non ajustée à laquelle le prix prend fin (sans objet si la date de fin non ajustée de la période d'un tableau donné est consécutive à la date de prise d'effet non ajustée de la période subséquente). Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – F Transaction – C si [Tableau Le nombre de valeurs de date doit éga] le nombre de valeurs de prix d'exercice – prix d'exercice si le champ est utilisé, sinon (champ vide). Sûretés – NR Valorisation – NR
67	CDE	Tableau de prix d'exercice – prix d'exercice	Chaque prix d'exercice, indiqué dans un tableau, en vigueur à compter de la date précisée dans l'élément de données 65 et celle stipulée dans l'élément de données 66.	Pour les options, les swaptions et les produits semblables dont le prix d'exercice varie pendant la durée de la transaction : Le prix d'exercice en vigueur entre la date de prise d'effet non ajustée et la date de fin non ajustée, inclusivement. Le tableau de prix d'exercice ne s'applique que si le prix d'exercice varie suivant le tableau en question. La monnaie des prix d'exercice variables figurant dans le tableau est à déclarer dans l'élément de donnée Prix d'exercice.	- Num(18,13) si la Notation du prix d'exercice = 1 - Num(11,10) si la Notation du prix d'exercice = 3	- Pour les options sur actions, les options sur marchandises, les options sur devises et les produits semblables, toute valeur (par exemple, 6,39 USD) exprimée sous la forme 6,39, si la Notation du prix d'exercice = 1; - Pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions de taux d'intérêt et les swaptions de crédit cotées en fonction de l'écart et les produits semblables, toute valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,021 au lieu de 2,1 %), si la Notation du prix d'exercice = 3.	N	Transaction – C si [Prix d'exercice] n'est pas utilisé et UPL[Type d'instrument] = « Option », sinon (champ vide)(facultatif) Le nombre de valeurs de prix d'exercice doit éga] le nombre d'intervalles de dates de début. Sûretés – NR Valorisation – NR
68	CFTC	Indicateur de modalités non normalisées	Indication que le dérivé comporte ou non au moins une disposition qui influe considérablement sur son prix, et qui n'a pas été diffusée dans le public.	Indique si la transaction de swap comporte au moins une modalité ou disposition, outre celles diffusées dans le public suivant la partie 43 ^{29,26} , qui influe considérablement sur son prix.	Booléen	- Vrai - Faux	O	Transaction – C si [Compensé] = « N »; NR si [Compensé] = « Y » ou « I »; sinon (facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
69	CDE	Convention de calcul des jours [convention de calcul des jours à taux fixe – branche 1] [convention de calcul des jours à taux fixe – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la convention de calcul des jours utilisée pour établir le mode de calcul des paiements d'intérêts.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la convention de calcul des jours (souvent aussi appelée fraction de décompte des jours, base de décompte des jours ou méthode de décompte des jours) qui établit le mode de calcul des paiements d'intérêts. Cet élément sert à déterminer la fraction représentée par la période de calcul dans l'année et correspond au nombre de jours compris dans cette période divisé par le nombre de jours dans l'année. Voir l'annexe 3.2 pour les définitions des valeurs.	Char(4)	- A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule - A002 = IC30365 - A003 = IC30Actual - A004 = Actual360 - A005 = Actual365Fixed - A006 = ActualActualCMA - A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 - A008 = ActualActualISDA - A009 = Actual365LorActuActubasisRule - A010 = ActualActualAFB	O	Transaction – [Convention de calcul des jours à taux fixe – branche 1] F si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 1] est utilisé, sinon (champ vide). [Convention de calcul des jours à taux fixe – branche 2]

^{29,26} La contrepartie déclarante peut déclarer l'élément de données d'une manière qui reflète la diffusion publique suivant les exigences d'une quelconque autorité de réglementation (par exemple, la partie 43 de la CFTC ou les règlements sur la déclaration des opérations).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
		[convention de calcul des jours à taux variable – branche 1] [convention de calcul des jours à taux variable – branche 2]				• A011 = IC30360ICMAor30360basicrule • A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 • A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 • A014 = Actual365NL • A015 = ActualActualUltimo • A016 = IC30EPlus360 • A017 = Actual364 • A018 = Business252 • A019 = Actual360NL • A020 = 1/1 • NARR = Narrative		F si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 2] est utilisé, sinon (champ vide) [Convention de calcul des jours à taux variable – branche 1] CO/EQ.C si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 1] est utilisé, sinon (facultatif) CR/IR/FX – F Transaction – CO/EQ [Convention de calcul des jours à taux variable – branche 2] CO/EQ.C si [Fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 2] est utilisé, sinon (champ vide)(facultatif) CR/IR/FX – F Sûretés – NR Valorisation – NR
70	CFTC	Fréquence de révision du taux variable – unité de temps [fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] [fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2]	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, l'unité de temps qui détermine la fréquence des révisions.	Pour chaque branche variable de la transaction de swap, s'il y a lieu, l'unité de temps associée à la fréquence des révisions (par exemple, jour, mois, année ou durée du flux).	Char(4)	• DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • YEAR = Annuelle • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers) • EXPI = Paiement à l'échéance	0	Transaction – [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] IR.C si UPI.[Type d'instrument] = « Swap » et UPI.[Type de l'actif sous-jacent] ≠ « Fixe - fixe » et [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] est NULL, sinon (champ vide)(facultatif) Lorsque cet élément contient la valeur « EXPI », [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur] doit contenir la valeur « 1 ».

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								[Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] IR.C si UPI [Type d'instrument] = « Swap » et UPI [Type d'actif sous-jacent] ≠ « Fixe - fixe » et [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] est NULL, sinon (facultatif) Transaction – CR/FX/EQ/ICO – NRE Sûretés – NR Valorisation – NR
71	CFTC	Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur [fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 1] [fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 2]	À l'égard de chaque branche variable d'un dérivé, le nombre par lequel est multipliée l'unité de temps de la fréquence de révision du taux variable afin de déterminer la fréquence des dates de révision du taux des paiements périodiques.	À l'égard de chaque branche variable de la transaction de swap, s'il y a lieu, le nombre d'unités de temps (indiqué par la Fréquence de révision du taux variable – unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates de révision du taux des paiements périodiques surviennent. Par exemple, une transaction dont les paiements révisables ont lieu tous les deux mois est représentée par une fréquence de révision du taux variable de « MNTH » (mensuelle) et une fréquence de révision du taux variable – multiplicateur de « 2 ». Cet élément de données ne s'applique pas si la fréquence de révision du taux variable est « ADHO ». Si elle est « EXPI », la fréquence de révision du taux variable – multiplicateur est « 1 ». Si elle est intrajournalière, la fréquence de révision du taux variable est « DAIL » et la fréquence de révision du taux variable – multiplicateur est « 0 ».	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 1] C si [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps] = branche 1 est utilisé et ≠ « ADHO », sinon (champ vide) [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur – branche 2] C si [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] est utilisé et ≠ « ADHO », sinon (champ vide) Lorsque [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 1] contient la valeur « EXPI », [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – multiplicateur – branche 1] doit être « 1 » Lorsque [Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – branche 2] contient la valeur « EXPI »,

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								[Fréquence de révision du taux variable – unité de temps – multiplicateur – branche 2] doit être « 1 » Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs à la compensation

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
72	CDE	Compensé	Indique si un dérivé a été ou sera compensé par une chambre de compensation.	Indique si la transaction a été ou sera compensée par une contrepartie centrale. ^{36 22}	Char(1)	- Y = Oui, compensé par une contrepartie centrale, pour les transactions de types bêta et gamma. - N = Non, pas compensé par une contrepartie centrale. - I = Compensation prévue, pour les transactions de type alpha qu'il est prévu de soumettre aux fins de compensation.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
73	CDE	Identifiant de la contrepartie centrale	Identifie la chambre de compensation qui a compensé le dérivé.	L'identifiant de la contrepartie centrale qui a compensé la transaction. Cet élément de données ne s'applique pas si la valeur de l'élément de données « Compensé » est « N » (non compensé par une contrepartie centrale) ou « I » (compensation prévue).	Char(20)	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction – C si [Compensé] = « Y » ²² ; sinon (facultatif). Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit correspondre à celle de [Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)] : NR si [Compensé] = « N » ; F si [Compensé] = « I ». ²² Sûretés – NR Valorisation – NR

^{36 22} Dans les explications des éléments de données du CDE, « contrepartie centrale » s'entend d'une chambre de compensation.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
74	CFTC	Origine du compte de compensation	Indique si le membre compensateur agit comme contrepartiste ou mandataire.	Indique si un membre compensateur a agi comme contrepartiste pour une chambre de compensation ou comme mandataire pour un client.	Char(4)	• HOUS = Chambre de compensation • CLIE = Client	N	Transaction – C si Compensé] = « NY »; NR si [Compensé] = « N » ou « I »; sinon (facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
75	CDE	Identifiant du membre compensateur	Identifie le membre compensateur qui fait compenser le dérivé auprès d'une chambre de compensation.	L'identifiant du membre compensateur par l'entremise duquel la transaction sur dérivé a été compensée auprès d'une contrepartie centrale. Cet élément de données s'applique aux transactions compensées dans le cadre du modèle de la transaction pour compte de tiers et du modèle de la transaction de contrepartie ^{31,28} . • Dans le cas du modèle de la transaction de contrepartie, le membre compensateur est identifié en tant que membre compensateur et également en tant que contrepartie dans les deux transactions résultant de la compensation : i) dans la transaction entre la contrepartie centrale et le membre compensateur ; et ii) dans la transaction entre le membre compensateur et la contrepartie à la transaction alpha initiale. • Dans le cas du modèle de la transaction pour compte de tiers, le membre compensateur est identifié en tant que membre de la chambre de compensation, mais non comme contrepartie aux transactions résultant de la compensation. Dans ce modèle, les contreparties sont la contrepartie centrale et le client. Cet élément de données ne s'applique pas si la valeur de l'élément de données « Compensé » est « N » (non compensé par une contrepartie centrale) ou « I » (compensation prévue).	• Char(20) pour un code LEI - ou • Varchar(72) pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) - ou • Varchar(72) code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage	• Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org). • Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. • Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Compensé] = « Y »; sinon (facultatif) NR si [Compensé] = « N » ou « I » Sûretés – NR Valorisation – NR
76	CFTC	Horodatage de la réception pour compensation	Date et heure, exprimées en temps universel coordonné, auxquelles le dérivé initial a été enregistré comme reçu par la chambre de compensation aux fins de compensation.	La date et l'heure, exprimées en temps universel coordonné (UTC), auxquelles l'organisme de compensation de dérivés reçoit pour compensation le swap conclu à l'origine et l'enregistre dans son système ^{32,29} .	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si ([Compensé] = « Y » ou ([Compensé] = « I » et [Type d'action] = « TERM »)) et [Type d'événement] = « CLRG »; sinon (champ vide); NR si ([Compensé] = « N ») et [Type d'action] = « TERM » et [Type d'événement] = « CLAL »; sinon (facultatif) Sûretés – NR

^{31,28} Les swaps compensés (« clearing swaps ») doivent être déclarés par la contrepartie déclarante selon le modèle de l'opération pour compte de tiers.

^{32,29} Dans les explications des éléments de données de la CFTC, « organisme de compensation de dérivés » (expression abrégée en anglais par « DCO ») s'entend d'une chambre de compensation.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Valorisation – NR
77	CFTC	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 1	Type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 1.	Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 1 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert ^{33 34} . Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu.	Char(4)	• AFFL = Dispense intragroupe • OTHR = Autres exceptions ou dispenses Valeurs supplémentaires, pertinentes uniquement pour la CFTC : • ENDU = exception relative à l'utilisateur final; • SMBK = exemption pour les petites banques; • COOP = exemption pour les coopératives; • NOAL = lettre de non-intervention.	N	Transaction – F si [Compensé] = « N »; NR si [Compensé] = « Y » ou « I » Sûretés – NR Valorisation – NR
78	CFTC	Exceptions et dispenses de compensation – contrepartie 2	Type de dispense ou d'exception de compensation applicable à la contrepartie 2.	Indique le type d'exception ou de dispense dont la contrepartie 2 a choisi de se prévaloir ou qui lui est par ailleurs ouvert. Toutes les exceptions et dispenses applicables doivent être sélectionnées. Les valeurs peuvent être répétées, s'il y a lieu.	Char(4)	• AFFL = Dispense intragroupe • OTHR = Autres exceptions ou dispenses Valeurs supplémentaires, pertinentes uniquement pour la CFTC : • ENDU = exception relative à l'utilisateur final; • SMBK = exemption pour les petites banques; • COOP = exemption pour les coopératives; • NOAL = lettre de non-intervention.	N	Transaction – F si [Compensé] = « N »; NR si [Compensé] = « Y » ou « I » Sûretés – NR Valorisation – NR

^{33 34} Voir les chapitres 3 et 5 de la norme nationale 94-101 Compensation du Règlement 94-101 sur la compensation obligatoire des dérivés par contrepartie centrale. Par ailleurs, la contrepartie déclarante peut présenter, pour les éléments de données 77 et 78, des exceptions à la compensation qui sont pertinentes pour la CFTC. Elle peut donc déclarer ces éléments de données selon les règlements sur la déclaration des opérations de la même manière qu'elle les déclare à la CFTC.

Éléments de données relatifs aux sûretés et aux marges

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
79	CDE	Catégorie de sûreté	Indique s'il existe une convention de sûreté entre les contreparties et précise la nature de la sûreté.	Indique s'il existe une ou plusieurs conventions de sûreté entre les contreparties (sans sûreté/couverture partielle/couverture à sens unique/couverture entière). Cet élément de données est fourni pour chaque transaction ou chaque portefeuille, selon que la constitution de sûreté est faite au niveau de la transaction ou du portefeuille, et est applicable aux transactions compensées ou non.	Char(4)	•UNCL •PRC1 •PRC2 •PRCL •OWC1 •OWC2 •OWP1 •OWP2 •FLCL	N	Transaction – NRQ Sûretés – O Valorisation – NR
80	CFTC	Portefeuille contenant un indicateur de composante à ne pas déclarer	Dans le cas où les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si le portefeuille inclut des dérivés visés par une dispense ou une exception de déclaration.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, indique si ce portefeuille inclut des transactions de swap dispensées de déclaration.	Booléen	• Vrai • Faux	N	Transaction – NR Sûretés – O Valorisation – NR
81	CDE	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante avant l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité à la contrepartie centrale, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés – C si ([Catégorie de sûreté = « OWC1 » ou « OWP1 » ou « FLCL »), sinon (champ facultatif) ³⁴³¹ Valorisation – NR

³⁴³¹ Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
82	CDE	Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale déposée par la contrepartie déclarante après l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité à la contrepartie centrale, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés – C si ([Catégorie de sûreté = « OWC1 » ou « OWP1 » ou « FLCL »], sinon { champ vide ^{35 32} }) Valorisation – NR
83	CDE	Monnaie de la marge initiale déposée ^{35 32}	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge initiale déposée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales déposées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)] ou [Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)] est utilisé, sinon { champ vide } Valorisation – NR
84	CDE	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante avant l'application de la décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la contrepartie centrale dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie,	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « OWC2 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon { champ vide ^{37 34} }) Valorisation – NR

^{35 32} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

^{36 33} Dans le cas d'un portefeuille comptant plusieurs monnaies, il faut le convertir en une monnaie unique choisie par la contrepartie déclarante et déclarer une seule valeur totale.

^{37 34} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.				
85	CDE	Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la contrepartie centrale dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « OWC2 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon { champ vide ^{38 35} facultatif} ^{39 36} Valorisation – NR
86	CDE	Monnaie de la marge initiale collectée ^{38 35}	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge initiale collectée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges initiales collectées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)] ou [Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)] est utilisé, sinon { champ vide } Valorisation – NR

^{38 35} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge initiale n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

^{39 36} Dans le cas d'un portefeuille comptant plusieurs monnaies, il faut le convertir en une monnaie unique choisie par la contrepartie déclarante et déclarer une seule valeur totale.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
87	CDE	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote) ^{40 27}	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC1 » ou « PRCL » ou « OWC1 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {ehamp videfacultatif}^{41 28} Valorisation – NR
88	CDE	Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au</u>	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC1 » ou « PRCL » ou « OWC1 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {ehamp videfacultatif}^{42 29} Valorisation – NR

^{40 27} Il est obligatoire de déclarer cet élément de données quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

^{41 28} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

^{42 29} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentés sous forme d'une valeur totale.				
89	CDE	Monnaie de la marge de variation déposée	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge de variation déposée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation déposées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)] ou [Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)] est utilisé, sinon {champ vide} Valorisation – NR
90	CDE	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote) ^{43 40}	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante avant l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation collectées pour le portefeuille ou la transaction. La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM). Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC2 » ou « PRCL » ou « OWC2 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon { champ vide facultatif} ^{44 41} Valorisation – NR

^{43 40} Il est obligatoire de déclarer cet élément de données quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

^{44 41} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.				
91	CDE	Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante après l'application d'une décote.	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau de chaque transaction, elle se rapporte à la transaction en particulier. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation collectée après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentée sous forme d'une valeur totale.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	N	Transaction – NR Sûretés C si ([Catégorie de sûreté] = « PRC2 » ou « PRCL » ou « OWC2 » ou « OWP1 » ou « OWP2 » ou « FLCL »), sinon {champ vide^{45 42}facultatif} Valorisation – NR
92	CDE	Monnaie de la marge de variation collectée	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée.	La monnaie dans laquelle la marge de variation collectée est libellée. Si elle est libellée dans plus d'une monnaie, cet élément de données reflète l'une de ces monnaies en lesquelles la contrepartie déclarante a choisi de convertir toutes les valeurs des marges de variation collectées.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés C si [Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)] ou [Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)] est utilisé, sinon {champ vide}

^{45 42} Si, pour un portefeuille donné, il existe une ou des conventions de sûreté, mais qu'aucune marge de variation n'est d'abord échangée entre les contreparties (p. ex. parce que l'exposition n'atteint pas le seuil négocié), déclarer zéro jusqu'à ce qu'un échange/transfert ait lieu.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
								Valorisation – NR
93	CFTCC DE	Code du portefeuille de sûretés – marge de variation	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge de variation relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge de variation globale <u>relative à un ensemble de transactions ouvertes d'opérations sur dérivés</u> . Cet élément de données ne s'applique pas si la constitution de sûretés a été effectuée au niveau de la transaction, ou s'il n'y a pas de convention de sûreté, ou si aucune <u>sûreté marge de variation</u> n'est déposée ou reçue. Le code du portefeuille est requis à la fois pour la déclaration des sûretés et pour la déclaration de la valorisation afin de relier les deux ensembles de données.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques ⁴⁶⁴³	N	Transaction – F Sûretés – O <u>Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon (facultatif).</u> <u>Valorisation – O Valorisation – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon (facultatif).</u>
94	CFTCC DE	Code du portefeuille de sûretés – marge initiale	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante qui identifie la marge initiale relative aux transactions ouvertes incluses dans le portefeuille.	Si les sûretés sont déclarées au niveau du portefeuille, le code unique attribué par la contrepartie déclarante au portefeuille qui suit la marge initiale globale relative à un ensemble <u>de transactions ouvertes d'opérations sur dérivés</u> . Cet élément de données ne s'applique pas si la constitution de sûretés a été effectuée au niveau de la transaction, ou s'il n'y a pas de convention de sûreté, ou si aucune <u>sûreté marge initiale</u> n'est déposée ou reçue. Le code du portefeuille est requis à la fois pour la déclaration des sûretés et pour la déclaration de la valorisation afin de relier les deux ensembles de données.	Varchar(52)	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques ⁴⁷⁴⁴	N	Transaction – F <u>Sûretés – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge de variation] n'est pas utilisé, sinon (facultatif).</u> Sûretés – O <u>Valorisation – O Valorisation – C si [Code du portefeuille de sûretés – marge initiale] n'est pas utilisé, sinon (facultatif).</u>

⁴⁶⁴³ Si les sûretés ont été constituées au niveau de l'opération, « TRANSACTIONLEVEL » est accepté. « NOTAPPLICABLE » est accepté si : i) les sûretés ont été constituées au niveau du portefeuille et il n'existe pas de code du portefeuille de sûretés pour la marge de variation; ou ii) la déclaration est transmise par un organisme de compensation de dérivés.

⁴⁷⁴⁴ Si les sûretés ont été constituées au niveau de l'opération, « TRANSACTIONLEVEL » est accepté. « NOTAPPLICABLE » est accepté si : i) les sûretés ont été constituées au niveau du portefeuille et il n'existe pas de code du portefeuille de sûretés pour la marge initiale; ou ii) la déclaration est transmise par un organisme de compensation de dérivés.

Éléments de données relatifs aux actions et aux événements

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
95	CDE	Horodatage de l'événement	La date et l'heure de l'événement relatif à un dérivé.	La date et l'heure de l'événement <u>pour lequel un rapport est établi</u> . Dans le cas d'une modification convenue pour une date future, cet élément de données doit correspondre à la date où la modification a lieu (prend effet) et non à celle où elle est négociée. Dans le cas d'une correction, cet élément de données doit correspondre à la date et à l'heure auxquelles la correction s'applique. Dans le cas d'un événement de compensation, cet élément de données doit correspondre à la date et à l'heure auxquelles la transaction alpha est acceptée pour compensation par la contrepartie centrale. Dans le cas d'une mise à jour des sûretés, la date et l'heure sont celles pour lesquelles les renseignements contenus dans le rapport sont fournis.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC ⁴⁸ .	Toute date ou heure valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – O La valeur sera égale ou postérieure à la valeur de [Horodatage de l'exécution]. Sûretés – O Valorisation – NR
96	CDE	Niveau	Indique si la déclaration se rapporte au dérivé ou à la position.	Indique si la déclaration s'effectue au niveau de l'opération ou à celui de la position. La déclaration au niveau de la position peut être faite en complément de celle au niveau de l'opération pour rendre compte d'événements postérieurs à l'opération et lorsque des opérations considérées individuellement sont remplacées par la position.	Char(4)	• TCTN = Opération • PSTN = Position	N	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
97	CDE	Identifiant d'événement	L'identifiant unique qui lie les dérivés se rapportant à un événement.	L'identifiant unique permettant de lier les transactions constituant un événement et en résultant, cet événement pouvant notamment être une compression ou autre mesure de réduction du risque postérieure à l'opération ou encore un événement de crédit. Cet identifiant unique peut être attribué par la contrepartie déclarante, un fournisseur de service ou la contrepartie centrale qui fournit le service ⁴⁹ .	Varchar(52)	Code LEI ISO 17442 de l'entité qui attribue l'identifiant de l'événement, suivi d'un identifiant unique d'un maximum de 32 caractères.	N	Transaction – C si [Type d'événement] = « COMP » ou « CREV », sinon { <u>champ vide</u> facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
98	CDE	Type d'action ⁵⁰	Précise le type d'action ou de déclaration qui se rapporte au dérivé ou à la position.	Type d'action réalisée à l'égard de la transaction ou type de déclaration de fin de journée. Voir l'annexe 3.8 pour la description des valeurs permises.	Char(4)	• NEWT = Nouveau • MODI = Modifier • CORR = Corriger • EROR = Erreur • REVI = Relancer • TERM = Mettre fin • PRTO = Transférer • VALU = Valorisation	O	Transaction – O – Pour les types d'action ou les types d'événement valides, voir l'annexe 3.5. Sûretés – O, doit correspondre à 'MARU'

⁴⁸ La déclaration doit inclure la partie date et la partie heure. Cet élément temporel est aussi précis qu'il est technologiquement possible de le faire. Si la partie heure n'est pas disponible, déclarer « 00:00:00 » à cet égard.

⁴⁹ L'identifiant qui se rapporte à un événement donné doit être le même dans tous les cas.

⁵⁰ Une seule valeur de type d'action par transmission; ne pas transmettre plusieurs valeurs de type d'action en une seule déclaration de transaction. Par exemple, s'il se trouve un élément de données à corriger dans une opération transmise précédemment qui prend fin, la valeur Corriger (CORR) est à transmettre séparément avant l'opération Mettre fin (TERM).

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
						• MARU = Mise à jour de sûreté/marge • POSC = Élément de position		Valorisation – M doit correspondre à 'VALU'
99	CDE	Type d'événement	Précise le type d'événement du cycle de vie ou le motif de l'action dont il est question à l'élément de données 98.	Explication ou motif de l'action réalisée à l'égard de la transaction. Voir l'annexe 3.7 pour la description des valeurs permises.	Char(4)	• TRAD = Opération • NOVA = Novation/intervention • COMP = Mesure de réduction du risque postérieure à l'opération • ETRM = Fin par anticipation • CLRG = Compensation • EXER = Exercice • ALOC = Affectation • CLAL = Compensation et affectation • CREV = Événement de crédit • PTNG = Transfert • INCP = Inclusion dans une position • CORP = Événement d'entreprise • UPDT = Mise à jour	O	Transaction – C – Pour les types d'action ou les types d'événement valides, voir l'annexe 3.5. Sûretés – NR Valorisation – NR
100	CFTC	Indicateur de modification	Indique si une modification du dérivé se rapporte à un événement.	Indique si la modification de la transaction rend compte de la nouvelle version convenue des modalités négociées antérieurement.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – C si [Type d'action] = « MODI », sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs à la valorisation

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
101	CDE	Montant de valorisation ⁵⁴⁴⁸	Valeur du dérivé.	La valeur actuelle du contrat en cours sans aucun ajustement d'évaluation (il pourrait s'agir, par exemple, des XVA tels que le CVA, le DVA, etc.). Le montant de valorisation est exprimé en coût de sortie du contrat ou de ses composantes <u>à un moment précis et non pas en variation de la valeur ou en variation cumulative de la valeur pendant une période donnée</u> , c'est-à-dire le prix auquel il serait vendu (sur le marché dans le cadre d'une transaction <u>en règle normale</u> à la date de valorisation). <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u>	Num(25,5)	Toute valeur numérique.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
102	CDE	Monnaie de valorisation	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	La monnaie dans laquelle le montant de valorisation est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
103	CDE	Méthode de valorisation	La source et la méthode utilisées pour valoriser le dérivé.	La source et la méthode utilisées pour la valorisation de la transaction par la contrepartie déclarante. S'il est utilisé au moins une donnée de valorisation classée sous la catégorie « selon un modèle » (mark-to-model) à l'annexe 3.3, alors toute la valorisation entre dans cette catégorie. Si seules sont utilisées des données de valorisation classées dans la catégorie « <u>à la valeur de au prix du</u> marché » à l'annexe 3.3, alors toute la valorisation entre dans cette catégorie.	Char(1)	• MTMA = Valorisation <u>à la valeur de au prix du</u> marché • MTMO = Valorisation selon un modèle • CCPV = Valorisation par la chambre de compensation (La classification des données de valorisation figure à l'annexe 3.3.)	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O, lorsque cet élément contient la valeur « CCPV » , [Compensé] doit contenir la valeur « Y »

⁵⁴⁴⁸ Il est obligatoire de déclarer le montant de valorisation quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
104	CDE	Horodatage de la valorisation	La date et l'heure auxquelles a été établie ⁵⁴⁹ <u>calculée</u> la valeur du dérivé visé dans l'élément de données 101.	La date et l'heure de la dernière valorisation à la valeur de ⁵⁵⁰ <u>au prix du</u> marché, fournie par la contrepartie centrale ⁵⁴⁹ ou calculée à l'aide du prix du marché en vigueur ou du dernier prix du marché des données d'entrée. Si, par exemple, le taux de change d'une monnaie est à la base de la valorisation d'une transaction, alors l'horodatage de la valorisation indique le moment où ce taux était en vigueur.	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ, exprimée en UTC] ⁵⁴⁹ ⁵⁵⁰ . Si l'élément temporel n'est pas requis dans une province, un territoire ou un État en particulier, l'heure peut être omise étant donné que, dans le cas de représentations à précision réduite, la norme ISO 8601 permet d'omettre des éléments de la représentation de la date/heure, l'omission commençant par l'extrême droite (dans l'ordre, à partir de l'élément le moins significatif).	Toute date ou heure valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – O
105	CFTC	Prochaine date de révision du taux variable de référence [prochaine date de révision du taux variable de référence – branche 1] [prochaine date de révision du taux variable de référence – branche 2]	Prochaine date à laquelle le taux variable de référence sera révisé.	La prochaine date à laquelle le taux variable de référence est révisé.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F Valorisation – F
106	CFTC	Dernière valeur du taux variable de référence [dernière valeur du taux variable de référence – branche 1] [dernière valeur du taux variable de référence – branche 2]	Valeur du taux variable de référence à la date visée dans l'élément de données 107.	L'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière date de révision du taux variable de référence.	Num(11,10)	Valeurs positives et négatives exprimées en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %)	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F
107	CFTC	Dernière date de révision du taux variable de référence [dernière date de révision du taux variable de référence – branche 1] [dernière date de révision du taux variable de référence – branche 2]	Date la plus récente de la révision du taux variable de référence.	La date de l'échantillonnage le plus récent de la valeur du taux variable servant au calcul des flux de trésorerie. Se rapporte à l'élément de données Dernière valeur du taux variable de référence.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – F

⁵⁴⁹ Déclarée par la chambre de compensation pour les dérivés compensés et par le courtier en dérivés pour les dérivés non compensés.

⁵⁵⁰ Il n'est pas nécessaire que l'horodatage de la valorisation comprenne l'heure. Le format exigé est AAAA-MM-JJ.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
108	CDE	Delta ⁵⁴ ⁵¹	Coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix du dérivé et la variation du prix du sous-jacent du dérivé.	Le coefficient exprimant le rapport entre la variation du prix d'une transaction sur dérivé de gré à gré et la variation du prix du sous-jacent.	Num(25,5)	Toute valeur <u>numérique</u> .	N	Transaction – NR Sûretés – NR Valorisation – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon { champ vide ⁵² ⁵³ facultatif}

Éléments de données relatifs aux paquets

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
109	CFTC	Indicateur de paquet de dérivés	Indication que le dérivé est ou non une composante d'un paquet qui inclut l'un des éléments suivants : a) au moins deux dérivés déclarés séparément par la contrepartie déclarante mais conclus en vertu d'une seule entente; b) au moins deux déclarations relatives au même dérivé si une seule ne peut suffire en raison des obligations de déclaration d'au moins un territoire du Canada ou étranger.	Indique si la transaction de swap fait partie d'un paquet de dérivés.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR
110	CDE	Identifiant de paquet de dérivés ⁵⁵ ⁵²	Identifie le paquet visé à l'élément de données 109.	L'identifiant (établi par la contrepartie déclarante) visant à lier : • au moins deux transactions qui sont déclarées séparément par la contrepartie déclarante, mais négociées ensemble en tant que produit d'une seule entente économique; • au moins deux rapports relatifs à la même transaction dès lors que l'obligation de déclaration dans un territoire ne permet pas sa déclaration dans un seul rapport aux référentiels centraux.	Varchar(100)	Jusqu'à 100 caractères alphanumériques. ⁵⁷ ⁵⁴	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True », sinon { champ vide ⁵² ⁵³ facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁴⁵¹ Il est obligatoire de déclarer le delta quotidiennement, qu'il ait varié ou non depuis la dernière déclaration.

⁵⁵⁵² La déclaration d'une fourchette de taux nécessite l'utilisation de ce champ pour lier les branches plafond et plancher. La déclaration d'un stellage nécessite l'utilisation de ce champ pour lier les branches swaption payeuse et swaption receveuse.

⁵⁷⁵⁴ Si la valeur n'est pas disponible, on peut utiliser « UNKNOWN ».

Numéro de l'élément de données	Sourc e	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				Un paquet⁵⁶⁵³ peut contenir des transactions à déclarer et d'autres n'ayant pas à l'être. Cet élément de données ne s'applique pas : • si aucun paquet de dérivés n'est concerné; ou • aux affectations. Si l'identifiant du paquet de dérivés est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu.				
111	CDE	Prix du paquet de dérivés	Prix du paquet visé à l'élément de données 109.	Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont la transaction sur dérivé déclarée est une composante. Cet élément de données ne s'applique pas : • si aucun paquet de dérivés n'est concerné; • si l'écart du paquet de dérivés est utilisé. Les prix et les éléments de données connexes des transactions (Monnaie du prix, Notation du prix, Unité de mesure du prix) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont à déclarer lorsqu'ils sont disponibles. Le Prix du paquet de dérivés peut être inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, mais il est possible de l'actualiser plus tard.	• Num(18,13) si la Notation du prix du paquet de dérivés = 1 • Num(11,10) si la Notation du prix du paquet de dérivés = 3	• N'importe quelle valeur si la Notation du prix du paquet de dérivés = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation du prix du paquet de dérivés = 3⁵⁶⁵⁵	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True » et si [Écart du paquet de dérivés] n'est pas utilisé, sinon (champ videfacultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
112	CDE	Monnaie du prix du paquet de dérivés	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé.	La monnaie dans laquelle le prix du paquet de dérivés est libellé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque l'écart du paquet de dérivés est utilisé; • lorsque la Notation du prix du paquet de dérivés = 3	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », sinon (champ videfacultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
113	CDE	Écart du paquet de dérivés	Prix du paquet visé à l'élément de données 109, exprimé sous forme d'écart.	Le prix négocié de l'ensemble du paquet dont la transaction sur dérivé déclarée est une composante. Le Prix du paquet de dérivés lorsque le prix est exprimé en écart, soit la différence entre deux prix de référence. Cet élément de données ne s'applique pas : • aucun paquet de dérivés n'est concerné; • le prix du paquet de dérivés est utilisé. L'écart et les éléments de données connexes des transactions (monnaie de l'écart) qui représentent les composantes individuelles du paquet sont déclarés quand ils sont disponibles. L'Écart du paquet de dérivés peut être inconnu lors de la	• Num(18,13) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 1 • Num(11,10) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 3 • Num(5) si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 4	• N'importe quelle valeur si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 1 • N'importe quelle valeur exprimée en décimales (par exemple, 0,0257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 3 • N'importe quelle valeur entière exprimée en points de base (par exemple, 257 au lieu de 2,57 %), si la Notation de l'écart du paquet de dérivés = 4	N	Transaction – C si [Indicateur de paquet] = « True » et si [Prix du paquet de dérivés] n'est pas utilisé, sinon (champ videfacultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁶⁵³ Un « paquet de dérivés » peut aussi être constitué d'une opération impliquant deux instruments ou plus : 1) conclus entre deux contreparties ou plus; 2) évalués ou cotés comme une seule opération économique comportant l'exécution simultanée ou quasi simultanée de tous ses composants; 3) dont l'exécution de chaque composant est conditionnelle à celle des autres composants; 4) dont chaque composant porte un identifiant unique de swap (IUS) ou un identifiant unique de transaction (UTI); et 5) dont chaque composant est déclaré séparément.

⁵⁶⁵⁵ Si la valeur est inconnue, on peut utiliser la valeur par défaut en inscrivant seulement des 9 en tout format autorisé. Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », utiliser « 99999,999999999999 » (18 caractères numériques, dont 13 décimales). Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 3 », utiliser « 9,999999999 » (11 caractères numériques, dont 10 décimales).

Numéro de l'élément de données	Sourc e	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
				déclaration d'une nouvelle transaction, mais il est possible de l'actualiser plus tard ⁵⁵ .				
114	CDE	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	Monnaie dans laquelle l'écart du paquet de dérivés est libellé.	La monnaie dans laquelle l'Écart du paquet de dérivés est libellé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque le prix du paquet de dérivés est utilisé; • lorsque l'écart du paquet de dérivés est exprimé en décimales ou en points de base.	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	N	Transaction – C si [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
115	CDE	Notation de l'écart du paquet de dérivés	Manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé.	La manière dont l'écart du paquet de dérivés est exprimé. Cet élément de données ne s'applique pas aux situations suivantes : • lorsqu'aucun paquet de dérivés n'est concerné; • lorsque le prix du paquet de dérivés est utilisé.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales • 4 = Points de base	N	Transaction – C si [Écart du paquet de dérivés] est utilisé, sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
116	CDE	Notation du prix du paquet de dérivés	Manière dont le prix du paquet de dérivés est exprimé.	La manière dont le Prix du paquet de dérivés est exprimé. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun paquet de dérivés n'est concerné.	Char(1)	• 1 = Montant monétaire • 3 = Décimales	N	Transaction – C si [Prix du paquet de dérivés] est utilisé, sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁵ Si la valeur est inconnue, on peut utiliser la valeur par défaut en inscrivant seulement des 9 en tout format autorisé. Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 1 », utiliser « 99999,999999999999 » (18 caractères numériques, dont 13 décimales). Lorsque [Notation du prix du paquet de dérivés] = « 3 », utiliser « 9,999999999 » (11 caractères numériques, dont 10 décimales). Lorsque [Notation de l'écart du paquet de dérivés] = « 4 », utiliser « 99999 » (5 caractères numériques, sans décimales).

Éléments de données relatifs au produit

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
117	CDE	Identifiant unique de produit ^{60,61}	Un code unique attribué par le Derivatives Service Bureau qui identifie un type de dérivé.	Un ensemble unique de caractères qui représente le dérivé de gré à gré.	Char(12)	Une liste des valeurs autorisées et de leur format sera publiée par le Derivatives Service Bureau (émetteur de l'identifiant unique de produit). Jusqu'à ce que ces identifiants uniques de produit soient disponibles, les contreparties déclarantes continueront d'utiliser comme éléments de données relatifs aux produits ceux qui sont uniques à chaque référentiel central.	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NRQ
118	CDE	Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance	Point au-delà duquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance réduit le notionnel d'une tranche.	Le point inférieur défini auquel le niveau de pertes du portefeuille sous-jacent réduit le notionnel d'une tranche. Par exemple, le notionnel d'une tranche avec un point d'attachement de 3 % sera réduit après que le portefeuille aura subi des pertes de 3 %. Cet élément de données ne s'applique pas si la transaction ne porte pas sur une tranche du swap sur défaillance (indice ou panier sur mesure).	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	N	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index tranche », sinon {champ vide/facultatif} ; Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit être inférieure à celle de l'élément [Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance]; Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
119	CDE	Point de détachement de l'indice de swaps sur défaillance	Point au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent d'un swap sur défaillance ne réduisent plus le notionnel d'une tranche.	Le point défini au-delà duquel les pertes du portefeuille sous-jacent ne réduisent plus le notionnel d'une tranche. Par exemple, le notionnel d'une tranche avec un point d'attachement de 3 % et un point de détachement de 6 % sera réduit après que le portefeuille aura subi des pertes de 3 %. Des pertes de 6 % dans le portefeuille épuiseront le notionnel de la tranche. Cet élément de données ne s'applique pas si la transaction ne porte pas sur une tranche du swap sur défaillance (indice ou panier sur mesure).	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	N	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index tranche », sinon {champ vide/facultatif} ; Lorsque cet élément est utilisé, la valeur doit être supérieure à celle de l'élément [Point d'attachement de l'indice de swaps sur défaillance]; Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶⁰Pour une explication des⁶¹ Le 20 février 2025, les ACVM ont publié la *Décision générale coordonnée 96-933 relative à la dispense temporaire de certaines obligations de déclaration de données sur les dérivés concernant l'identifiant unique de produit pour les dérivés sur marchandises, qui permet aux participants au marché de continuer à déclarer les* identifiants uniques de produit, voir sous 1.2.6, « Utilisation des types d'instrument UPI » pour les dérivés sur marchandises conformément aux règlements en vigueur à cette date : <https://www.autorites-valeurs-mobilières.ca/nouvelles/les-acvm-annoncent-loctroi-de-dispenses-temporaires-en-faveur-des-participants-aux-marchés-des-dérivés/>.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
120	CFTC	Facteur d'indice	Facteur de la version de l'indice ou le pourcentage utilisé pour établir le montant notionnel d'un swap sur défaillance.	Le facteur ou pourcentage de la version de l'indice, exprimé en valeur décimale, qui, multiplié par le Montant notionnel, donne le montant notionnel couvert par le vendeur de la protection du swap sur défaillance.	Num(11,10)	Toute valeur comprise entre 0 et 1 (y compris 0 et 1), exprimée sous forme décimale (par exemple, 0,05 au lieu de 5 %).	O	Transaction – CR – C si UPI.[Type de sous-jacent] = « Index » ou « Index tranche », sinon (champ vide facultatif) Transaction – IR/FX/CR – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
121	CDE	Indicateur de cryptoactif sous-jacent [indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 1] [indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 2]	Indication que le sous-jacent du dérivé est ou non un cryptoactif.	Indique si le sous-jacent du dérivé est un cryptoactif. Cet élément est à déclarer comme « vrai » si l'un ou l'autre des sous-jacents (le sous-jacent immédiat ou le sous-jacent ultime) est un cryptoactif ou encore lorsque le dérivé repose sur un mélange de cryptoactifs et d'autres sous-jacents.	Booléen	• vraiVrai si le sous-jacent est un cryptoactif • fauxFaux si le sous-jacent n'est pas un cryptoactif	N	Transaction – CO – FQ Sûretés – NR Valorisation – NR
122	CDE	Code du panier sur mesure	Identifiant unique pour le panier sur mesure de l'actif de référence.	Si la transaction sur dérivé de gré à gré repose sur un panier sur mesure, le code unique attribué par le structeur du panier afin d'en lier les composants. Cet élément de données ne s'applique pas lorsqu'aucun panier sur mesure n'est en cause ou qu'aucun code unique n'a été attribué au panier.	Varchar(72)	L'identifiant pour les entités juridiques (code LEI) ISO 17442 du structeur du panier ⁶⁴⁵⁸ , suivi d'un identifiant unique d'un maximum de 52 caractères alphanumériques.	N	Transaction – C si [Indicateur de panier sur mesure] = « Vrai », sinon (champ vide facultatif) Sûretés – NR Valorisation – NR
123	CFTC	Indicateur de panier sur mesure	Indication que l'élément sous-jacent du dérivé est ou non un panier sur mesure.	Indique si la transaction de swap repose sur un panier sur mesure.	Booléen	• Vrai • Faux	O	Transaction – O Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶⁴⁵⁸ Le code LEI doit correspondre à celui de l'entité qui attribue le code du panier sur mesure.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
124	CDE	Identifiant des composantes du panier	Identifie un actif de référence composant le panier sur mesure.	L'identifiant qui représente un composant d'un panier sur mesure sous-jacent en phase avec l'identifiant du sous-jacent ⁵⁹ sous-jacent dans les éléments de données de référence des UPI ISO 4914 maintenus par le fournisseur de services UPI ou avec un identifiant qui serait à déclarer comme Identifiant du sous-jacent (Autre) si l'UPI Identifiant du sous-jacent était « AUTRE ». Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Varchar(350 ⁶⁰ 210) ⁵⁹	Tout identifiant pouvant être utilisé pour désigner un actif, un indice ou une référence compris dans un panier ⁶² ⁶⁰ . Jusqu'à 350 caractères alphanumériques.	N	Transaction – C si [Indicateur de Code du panier sur mesure] = « Vrai », sinon {champ vide facultatif} Le nombre de valeurs de l'identifiant de composant du panier doit évaluer le nombre de valeurs de l'unité de mesure de composant du nombre d'unités et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR
125	CDE	Source de l'identifiant des composantes du panier	Source de l'identifiant des composantes du panier visé à l'élément de données 124.	L'origine ou l'éditeur de l'identifiant de composant du panier associé, en phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence des UPI ISO 4914 maintenus par le fournisseur de services UPI ou avec la valeur permise qui serait à déclarer comme Identifiant du sous-jacent (Autre) si l'UPI Identifiant du sous-jacent était « AUTRE ». Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Varchar(350 ⁶¹ 100) ⁶¹	L'origine ou l'éditeur ⁶² ⁶¹ de l'identifiant de composant du panier associé. Jusqu'à 350 caractères alphanumériques.	N	Transaction – C si [Identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon {champ vide facultatif} Le nombre de valeurs de l'identifiant de composant du panier doit évaluer le nombre de valeurs de l'unité de mesure et du nombre d'unités. Sûretés – NR Valorisation – NR

⁵⁹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶⁰ En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶¹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶² En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
126	CDE	Nombre d'unités des composantes du panier	Nombre d'unités de chaque actif de référence composant le panier sur mesure.	Le nombre d'unités d'un composant particulier d'un panier sur mesure. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Num(18,13)	Toute valeur supérieure à zéro ^{64,65} .	N	Transaction – C si [l'identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon (champ vide facultatif) Le nombre de valeurs du nombre d'unités de composant du panier doit égaliser le nombre de valeurs de l'identifiant de composant, de l'unité de mesure et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR
127	CDE	Unité de mesure des composantes du panier	Unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités visé dans l'élément de données 126.	Unité de mesure dans laquelle est exprimé le nombre d'unités d'un composant particulier d'un panier sur mesure. Cet élément de données ne s'applique pas si aucun panier sur mesure n'est concerné.	Char Varchar(4)	Jeu de codes d'unités de mesure externe conforme à ISO 20022 ⁶⁴	N	Transaction – C si [l'identifiant de composant du panier] est utilisé, sinon (champ vide facultatif) Le nombre de valeurs de l'unité de mesure de composant du panier doit égaliser le nombre de valeurs de l'identifiant de composant, du nombre d'unités et de la source de l'identifiant. Sûretés – NR Valorisation – NR

^{64,65} Dans le cas d'un panier de marchandises qui comporte une formule de calcul utilisant différentes pondérations d'indices, fournir les valeurs sans le symbole de pourcentage. Par exemple, pour 10 %, déclarer « 10 ».

⁶⁴ Autres codes d'unités de mesure approuvés pour la DD (liés aux transactions sur cryptoactifs) permis pour les ACVM.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
128	CDE	Identifiant du sous-jacent (Autre) [identifiant du sous-jacent (Autre) – branche 1] [identifiant du sous-jacent (Autre) – branche 2]	Identifie chaque élément sous-jacent du dérivé.	Les actifs, indices ou références sous-jacents au contrat ou, dans le cas d'un dérivé de change, l'identifiant de l'indice ⁶⁵ . Cet élément de données ne s'utilise que lorsque la valeur de l'identifiant du sous-jacent transmise au fournisseur de service UPI est « AUTRE » ^{66,65} .	Varchar(350210) ⁶⁶	Tout identifiant ⁶⁷ pouvant être utilisé pour désigner les actifs, indices ou références sous-jacents à un contrat. Jusqu'à 350210 caractères alphanumériques. <u>Pour un « Identifiant du sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, soit la source de données de référence des énumérations du fournisseur de services UPI pour ces identifiants, se reporter à la rubrique 3.9 de l'Annexe.</u>	N	Transaction – C si [Identifiant du sous-jacent ⁶⁸] = « Autre », sinon { champ vide } ⁶⁹ Sûretés – NR Valorisation – NR
129	CDE	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) [source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) - branche 1] [source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) - branche 2]	Source de l'identifiant du sous-jacent (Autre) visé dans l'élément de données 128.	L'origine ou l'éditeur de l'identifiant du sous-jacent (autre) associé. Cet élément de données ne s'utilise que lorsque la valeur de la source de l'identifiant du sous-jacent transmise au fournisseur de service UPI est « AUTRE »	Varchar(350100) ⁶⁶	L'origine ou l'éditeur ^{69,70} de l'identifiant du sous-jacent associé. Jusqu'à 350100 caractères alphanumériques. <u>Pour une « Source de l'identifiant du sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, soit la source de données de référence des énumérations du fournisseur de services UPI pour ces identifiants, se reporter à la rubrique 3.10 de l'Annexe.</u>	N	Transaction – C si [Identifiant du sous-jacent (autre)] est utilisé, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
130	CDE	Identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent [identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent - branche 1] [identifiant de la plateforme de négociation de l'actif sous-jacent - branche 2]	Identifie la plateforme sur laquelle est négocié le sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	Pour un actif sous-jacent négocié sur une plateforme (p. ex., une bourse), la plateforme sur laquelle cet actif se négocie ^{70,71} . Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré qui portent sur les composants d'un panier sur mesure.	Char(4)	Code d'identification de marché de segment ISO 10383	N	Transaction – EQ/CR-F Sûretés – NR Valorisation – NR

⁶⁵ ~~S'il existe plus d'un sous-jacent, le dérivé est considéré comme un panier; il faut alors utiliser les champs de panier correspondants.~~

^{66,65} Lorsqu'un identifiant de sous-jacent particulier n'est pas pris en charge par le fournisseur de services UPI (cet identifiant du sous-jacent est « Autre »), c'est dans ce champ qu'on le déclare au référentiel central.

⁶⁶ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

⁶⁷ En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

⁶⁸ Dépendamment du produit, il se peut que le DSB utilise, pour désigner l'actif ou l'indice sous-jacent au dérivé, des attributs portant des noms tels que Taux de référence, Indice de l'instrument sous-jacent, ISIN de l'instrument sous-jacent, LEI de l'instrument sous-jacent ou autres.

⁶⁹ Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

^{69,70} En phase avec l'identifiant du sous-jacent dans les éléments de données de référence de l'identifiant unique de produit maintenus par le fournisseur de services UPI, ou en conformité avec l'article 5.2 du document CPIM-OICV *Technical Guidance : Harmonization of the Unique Product Identifier*.

^{70,71} La plateforme déclarée doit être celle d'où provient le prix de l'actif sous-jacent.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
131	CDE	Source du prix de l'actif sous-jacent [source du prix de l'actif sous-jacent – branche 1] [source du prix de l'actif sous-jacent – branche 2]	Source du prix utilisé pour établir la valeur ou le niveau du sous-jacent visé dans l'élément de données 128.	Pour un actif sous-jacent ou une référence qui ne sont pas négociés sur une plateforme, la source de prix ayant servi à déterminer la valeur ou le niveau de l'actif ou de la référence. Cet élément de données ne s'applique pas aux transactions sur dérivés de gré à gré qui portent sur les composants d'un panier sur mesure.	Varchar(50) ⁷²	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques.	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
132	CFTC	Type d'option incorporée	Type de disposition facultative dans un dérivé.	Le type d'option ou de disposition facultative incorporée dans un contrat.	Char(4)	• MDET = Fin par anticipation obligatoire • OPET = Fin par anticipation facultative • CANC = Annulable • EXT D = Renégociable • OTHR = Autre	O	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR

Éléments de données relatifs aux paiements et au règlement

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
133	CDE	Date contractuelle de règlement définitif	Date précisée dans la convention à laquelle il faut avoir rempli toutes les obligations prévues par le dérivé.	Date non ajustée prévue par le contrat à laquelle tous les transferts d'espèces ou d'actifs devraient avoir lieu et les contreparties ne devraient plus avoir d'obligations réciproques impayées en vertu du contrat. Pour les produits qui peuvent ne pas avoir de date contractuelle de règlement définitif (par exemple, les options américaines), cet élément de données reflète la date à laquelle le transfert d'espèces ou d'actifs s'effectuerait si la fin avait lieu à la date d'expiration.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	N'importe quelle date valide.	N	Transaction – C si l'UPI [Retour ou paiement] n'est pas un contrat⁷² « Contrat sur différence (CFD) », sinon (champ vide facultatif). Lorsque cet élément est utilisé, la valeur sera égale ou postérieure à la valeur de l'élément [Date d'expiration]. Sûretés – NR Valorisation – NR

⁷² Ce champ permet l'utilisation de texte de format libre.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
134	CDE	Lieu de règlement	Lieu de règlement du dérivé.	Le lieu de règlement de la transaction prévu dans le contrat. Cet élément de données ne s'applique qu'aux transactions visant une monnaie étrangère (soit une monnaie ne figurant pas sur la liste de monnaies de la norme ISO 4217, par exemple le CNH).	Char(2)	Codes de pays de la norme ISO 3166 utilisant un code à deux lettres (alpha-2)	N	Transaction – F Sûretés – NR Valorisation – NR
135	CDE	Monnaie de règlement [monnaie de règlement – branche 1] [monnaie de règlement – branche 2]	À l'égard de chaque branche du dérivé, la monnaie dans laquelle le règlement en espèces est libellé.	La monnaie du règlement en espèces, le cas échéant. Pour les produits en plusieurs monnaies qui ne sont pas compensés, la monnaie de règlement de chaque branche. Cet élément de données ne s'applique pas aux produits compensés par la livraison physique de marchandises (par exemple, les swaptions compensées par la livraison physique de marchandises).	Char(3)	Monnaies incluses dans les codes de monnaie ISO 4217.	O	Transaction – C si UPI.[Type de remise] = « Cash », sinon { champ vide facultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
136	CDE	Montant de l'autre paiement ^{24,25}	Montant de chaque paiement prévu par un dérivé, à l'exception du montant de la prime de l'option visé dans l'élément de données 144.	Les montants de paiement avec les types de paiements correspondants afin de tenir compte des obligations relatives aux descriptions des transactions pour différentes catégories d'actifs.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – C si [Type d'autre paiement] est utilisé, sinon {champ vide} Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit évaluer le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR
137	CDE	Monnaie de l'autre paiement	Monnaie dans laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 est libellé.	La monnaie dans laquelle le Montant de l'autre paiement est libellé.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon {champ vide} Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit évaluer le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]. Sûretés – NR Valorisation – NR

^{24,25} Dans le cas de paiements multiples, la série d'éléments de données se rattachant aux autres paiements (Type d'autre paiement [#141], Montant de l'autre paiement [#136], Date de l'autre paiement [#138], Payeur de l'autre paiement [#139], Receveur de l'autre paiement [#140]) peuvent être déclarée plusieurs fois.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
138	CDE	Date de l'autre paiement	Date à laquelle le montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136 sera payé.	La date non ajustée à laquelle le Montant de l'autre paiement est versé.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	N'importe quelle Toute date valide <u>basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601</u> .	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon (champ vide) <u>Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit évaluer le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]</u> . Sûretés – NR Valorisation – NR
139	CDE	Payeur de l'autre paiement	Identifie le payeur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	L'identifiant du payeur du Montant de l'autre paiement.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon (champ vide) <u>Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit évaluer le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]</u> . Sûretés – NR Valorisation – NR
140	CDE	Receveur de l'autre paiement	Identifie le receveur du montant de l'autre paiement visé dans l'élément de données 136.	Identifiant du receveur du montant de l'autre paiement.	• Char(20) pour un code LEI ou • Varchar(72), pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers et qui ne sont pas admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity (particuliers agissant dans le cadre d'une activité commerciale) ou • Varchar(72), code d'identification interne d'une contrepartie non déclarante soumise à une loi de blocage.	Code LEI ISO 17442 qui est inclus dans les données LEI publiées par la Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). Pour les personnes physiques qui agissent en tant que particuliers (non admissibles à un code LEI selon la politique du ROC – Individuals Acting in a Business Capacity) : code LEI de la contrepartie déclarante suivi d'un identifiant unique attribué et utilisé systématiquement par la contrepartie déclarante pour cette ou ces personnes physiques aux fins de déclaration réglementaire. Un code d'identification interne comme identifiant de la contrepartie non déclarante si cette contrepartie ou cette transaction est soumise à une loi de blocage et que la contrepartie déclarante bénéficie d'une dispense de ces obligations de déclaration des données sur les dérivés.	N	Transaction – C si [Montant de l'autre paiement] est utilisé, sinon (champ vide) <u>Si ce champ contient plusieurs valeurs, le nombre de valeurs doit évaluer le nombre de valeurs contenues dans [Type de l'autre paiement]</u> . Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
141	CDE	Type de l'autre paiement	Motif du paiement visé dans l'élément de données 136.	Le type de Montant de l'autre paiement. Le paiement de la prime de l'option n'est pas inclus en tant que type de paiement, car les primes de la sorte sont déclarées à l'aide de l'élément de données qui y est consacré.	Char(4)	• UFRO = Paiement forfaitaire unique, c'est-à-dire le paiement initial effectué par l'une des contreparties pour ramener une transaction à sa juste valeur ou pour toute autre raison pouvant être à l'origine d'une transaction hors marché. • UWIN = Rétrocession ou fin complète, c'est-à-dire le paiement de règlement définitif effectué lorsqu'une transaction fait l'objet d'une rétrocession avant sa date de fin; paiements pouvant résulter de la fin complète d'une ou de plusieurs transactions sur dérivés. • PEXH = Échange de notionnel, c'est-à-dire un échange des valeurs notionnelles pour des swaps sur devises.	O	Transaction – CR C, au moins un de ces éléments est requis : ([Taux fixe] ou [Écart] ou [Type d'autre paiement]) = « UFRO »²²⁴, <u>sinon (facultatif)</u>. Les valeurs autorisées UWIN et PEXH sont facultatives et indépendantes de la condition ci-dessus. Transaction – IR/FX/EQ/CO F Sûretés – NR Valorisation – NR
142	CDE	Fréquence des paiements – unité de temps²²⁴ [fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 1] [fréquence des paiements – unité de temps – taux fixe – branche 2] [fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 1] [fréquence des paiements – unité de temps – taux variable – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, l'unité de temps de la fréquence des paiements.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : l'unité de temps associée à la fréquence des paiements, par exemple, jour, mois, année ou durée du flux.	Char(4)	• DAIL = Quotidienne • WEEK = Hebdomadaire • MNTH = Mensuelle • YEAR = Annuelle • ADHO = Ad hoc (s'applique lorsque les paiements sont irréguliers) • EXPI²²⁵ = Paiement à l'échéance	O	Transaction – CR/IR/EQ/CO F <u>lorsque cet élément contient la valeur « EXPI »</u>, [Fréquence de révision du taux variable – multiplicateur] doit être « 1 » Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR

²²⁴ Pour représenter un paiement trimestriel, déclarer [Fréquence des paiements – unité de temps] = « MNTH » et [Fréquence des paiements – multiplicateur] = « 3 ». Pour un paiement semestriel, déclarer [Fréquence des paiements – unité de temps] = « MNTH » et [Fréquence des paiements – multiplicateur] = « 6 ».

²²⁵ Pour la valeur autorisée « EXPI » des éléments qui concernent l'unité de temps, on trouve dans le *Manuel technique* deux descriptions différentes, « Paiement à l'échéance » et « Fin du contrat », qui signifient essentiellement la même chose et représentent la fréquence/le taux de paiement/quantité.

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
143	CDE	Fréquence des paiements – multiplicateur [fréquence des paiements – multiplicateur – taux fixe – branche 1] [fréquence des paiements – multiplicateur – taux fixe – branche 2] [fréquence des paiements – multiplicateur – taux variable – branche 1] [fréquence des paiements – multiplicateur – taux variable – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, le nombre par lequel les unités de temps de la fréquence des paiements sont multipliées afin d'établir la fréquence des dates des paiements périodiques.	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : le nombre d'unités de temps (exprimé par la Fréquence des paiements – unité de temps) qui détermine la fréquence à laquelle les dates des paiements périodiques surviennent. Par exemple, une transaction dont les paiements ont lieu tous les deux mois est représentée par une Fréquence des paiements – unité de temps de « MNTH » (mensuelle) et une Fréquence des paiements – multiplicateur de « 2 ». Cet élément de données ne s'applique pas si la Fréquence des paiements – unité de temps est « ADHO ». Si elle est « EXPI », la Fréquence des paiements – multiplicateur est « 1 ». Si elle est intrajournalière, la Fréquence des paiements – unité de temps est « DAIL » et la Fréquence des paiements – multiplicateur est « 0 ».	Num(3,0)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – CR/IR/EQ/CO C si [Fréquence des paiements – unité de temps] ≠ « ADHO », sinon {champ vide}. Lorsque [Fréquence des paiements – unité de temps] contient la valeur « EXPI », [Fréquence des paiements – multiplicateur] doit être « 1 ». Transaction – FX – NR Sûretés – NR Valorisation – NR
144	CDE	Montant de la prime de l'option	Prime payée par l'acheteur d'une option ou d'une swaption.	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, le montant monétaire payé par l'acheteur de l'option. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.	Num(25,5)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon { champ vide facultatif } Sûretés – NR Valorisation – NR
145	CDE	Monnaie de la prime de l'option	Monnaie dans laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est libellée.	Pour les options et les swaptions de toutes les catégories d'actifs, la monnaie dans laquelle la prime de l'option est libellée. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.	Char(3)	Monnaies incluses dans la norme ISO 4217.	O	Transaction – C si [Montant de la prime de l'option] > 0, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR
146	CDE	Date de paiement de la prime de l'option	Date à laquelle la prime visée dans l'élément de données 144 est payée.	La date non ajustée à laquelle la prime de l'option est payée.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – C si [Montant de la prime de l'option] > 0, sinon {champ vide} Sûretés – NR Valorisation – NR

Numéro de l'élément de données	Source	Nom de l'élément de données	Description de l'élément de données (de l'annexe A des règlements sur la déclaration des opérations)	Explication détaillée de l'élément de données	Format	Valeurs	Mis à la disposition du public	Validations
147	CDE	Première date d'exercice	Première date à laquelle une option peut être exercée.	La première date non ajustée à laquelle une option peut être exercée durant la période d'exercice. Pour les options de type européen, cette date correspond à la Date d'expiration. Pour celles de type américain, la première date d'exercice possible est la date non ajustée indiquée dans l'Horodatage de l'exécution. Dans le cas des options barrières activantes, lorsque la première date d'exercice est inconnue au moment de la déclaration d'une nouvelle transaction, cet élément de données est actualisé lorsqu'elle devient disponible. Cet élément de données ne s'applique pas si l'instrument n'est pas une option ou qu'aucune option n'y est incorporée.	AAAA-MM-JJ, exprimée en UTC.	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	O	Transaction – C si UPI.[Type d'instrument] = « Option », sinon {champ videfacultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR
148	CFTC	Date de fixation [date de fixation – branche 1] [date de fixation – branche 2]	À l'égard de chaque branche d'un dérivé, la date à laquelle le taux de référence est établi.	La date précise à laquelle est « fixé » à un contrat à terme de gré à gré non livrable, ainsi qu'à divers types d'options sur devises de gré à gré comme les options réglées en espèces, un taux de change particulier, qui servira à calculer le règlement en espèces ultime.	AAAA-MM-JJ	Toute date valide basée sur le format de date et d'heure de la norme ISO 8601.	N	Transaction – CR/IR/EQ/CO F Transaction – FX C si UPI.[Type d'instrument] = « Forward » ou « Option » et si UPI.[Type de remise] = « Cash », sinon {champ videfacultatif} Sûretés – NR Valorisation – NR

2.1 Lignes directrices pour la déclaration des positions

Nom de l'élément de données	Explication détaillée de l'élément de données	Déclaration de positions
Identifiant de l'acheteur	L'identifiant de la contrepartie qui est l'acheteur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	Lorsque l'identifiant de l'acheteur est pertinent, la détermination de l'acheteur/du vendeur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.

Identifiant du vendeur	L'identifiant de la contrepartie qui est le vendeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des contrats à terme de gré à gré et des contrats semblables (à l'exception des contrats de change à terme et des contrats de change à terme non livrables); • la plupart des contrats d'option et des contrats semblables, y compris les swaptions, les plafonds et les planchers; • les swaps sur défaillance (acheteur/vendeur de protection); • les swaps de variance, de volatilité et de corrélation; • les contrats sur différence et les spreadbets (paris sur écart). Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant du payeur et Identifiant du receveur.	Lorsque l'identifiant du vendeur est pertinent, la détermination de l'acheteur/du vendeur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Identifiant du payeur [identifiant du payeur – branche 1] [identifiant du payeur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche du payeur au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	Lorsque l'identifiant du payeur est pertinent, la détermination du payeur/receveur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Identifiant du receveur [identifiant du receveur – branche 1] [identifiant du receveur – branche 2]	L'identifiant de la contrepartie de la branche receveuse au moment de la transaction. Voici une liste non exhaustive d'exemples d'instruments auxquels cet élément de données pourrait s'appliquer : • la plupart des swaps et des contrats assimilables à des swaps, y compris les swaps sur taux d'intérêt, les swaps sur rendement total de crédit et les swaps d'actions (à l'exception des swaps sur défaillance et des swaps de variance, de volatilité et de corrélation); • les swaps sur devises, les contrats à terme de gré à gré, les contrats à terme de gré à gré non livrables. Cet élément de données ne s'applique pas aux types d'instruments couverts par les éléments de données Identifiant de l'acheteur et Identifiant du vendeur.	Lorsque l'identifiant du receveur est pertinent, la détermination du payeur/du receveur est effectuée en fonction du résultat net de tous les éléments de la position.
Date d'entrée en vigueur	La date non ajustée, indiquée dans la confirmation, à laquelle les obligations relatives à la transaction sur un dérivé de gré à gré entrent en vigueur.	Date d'entrée en vigueur initialement déclarée lorsque la position a été acquise.
Identifiant unique de transaction (UTI)	Un identifiant unique attribué à tous les dérivés déclarés au niveau de la transaction ou de la position, qui sert à les identifier de manière unique pendant tout leur cycle de vie dans l'ensemble des dossiers.	Nouvel UTI créé pour la position
Montant notionnel [montant notionnel – branche 1] [montant notionnel – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : • pour les transactions sur dérivés de gré à gré négociées en montants monétaires, le montant stipulé dans le contrat; • pour les transactions sur dérivés de gré à gré non négociées en montants monétaires, se reporter à l'annexe 3.1 pour la conversion des montants notionnels en des montants non monétaires. De plus : • pour les transactions sur dérivés de gré à gré prévoyant un tableau de montants notionnels, le montant notionnel initial convenu par les contreparties au début de la transaction est déclaré sous cet élément de données; • pour les options sur devises de gré à gré, outre cet élément de données, les montants sont déclarés au moyen des éléments de données Montant d'achat et Montant de vente; • pour les modifications ou les événements du cycle de vie, le montant notionnel en cours qui en résulte est déclaré (les réalisations des étapes des tableaux des montants notionnels ne sont pas considérées comme des modifications ou des événements du cycle de vie); • si le montant notionnel est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, cet élément de données est actualisé dès qu'il devient disponible. Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	Le montant notionnel correspond au résultat net des éléments de la position acheteur/vendeur ou payeur/receveur.
Montant d'achat [montant d'achat – branche 1] [montant d'achat – branche 2]	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit d'acheter.	Le montant d'achat correspond à la somme de tous les montants d'achat inclus dans la position.
Montant de vente [montant de vente – branche 1] [montant de vente – branche 2]	Pour les options sur devises, le montant monétaire que l'option donne le droit de vendre.	Le montant de vente correspond à la somme de tous les montants de vente inclus dans la position.
Quantité notionnelle [quantité notionnelle – branche 1]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : relativement aux transactions sur dérivés négociées en montants non monétaires prévoyant une quantité notionnelle fixe pour chaque période du tableau (par exemple, 50 barils par mois). La fréquence est déclarée dans la Fréquence de cotation de la quantité, et l'unité de mesure est l'Unité de mesure de la quantité.	La quantité notionnelle correspond à la quantité notionnelle nette des éléments de la position acheteur/vendeur.

[quantité notionnelle – branche 2]		
Quantité notionnelle totale [quantité notionnelle totale – branche 1] [quantité notionnelle totale – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu : la Quantité notionnelle globale de l'actif sous-jacent pendant la durée de la transaction. Lorsque la Quantité notionnelle totale est inconnue au moment de la déclaration de la nouvelle transaction, elle doit être mise à jour dès qu'elle est connue.	La quantité notionnelle totale correspond à la quantité notionnelle totale nette des éléments de la position acheteur/vendeur.
Prix	Le prix spécifié de la transaction sur dérivé de gré à gré, les frais, droits, taxes et commissions étant exclus. Pour les swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et les produits semblables avec paiements périodiques, cet élément de données renvoie au prix fixe de la ou des branches fixes. Pour les contrats à terme sur marchandises et sur actions de gré à gré et les produits semblables, il renvoie au prix à terme de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les swaps d'actions, les swaps de portefeuilles et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent ou de référence. Pour les contrats sur différence et les produits semblables, il renvoie au prix initial de l'actif sous-jacent. Cet élément de données ne s'applique pas dans les cas suivants : • Les swaps de taux d'intérêt et les contrats de garantie de taux de gré à gré, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe et Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur taux d'intérêt et les swaptions sur taux d'intérêt, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps de référence sur marchandises et la branche variable des swaps sur marchandises à taux fixe-variable, car il est entendu que les renseignements inclus dans l'élément de données Écart peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps, contrats à terme de gré à gré et contrats d'option sur devises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux de change, Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur actions, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les swaps sur défaillance et les swaps sur rendement total de crédit, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Taux fixe, Écart et Paiement forfaitaire unique (Type d'autre paiement : Paiement forfaitaire unique) peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. • Les options sur marchandises, car il est entendu que les renseignements inclus dans les éléments de données Prix d'exercice et Prime de l'option peuvent être interprétés comme le prix de la transaction. Si le prix est inconnu lors de la déclaration d'une nouvelle transaction, il doit être mis à jour dès qu'il est connu. Pour les transactions qui font partie d'un paquet, cet élément de données contient le prix de la transaction qui en est une composante, le cas échéant.	Prix moyen pondéré en fonction du volume.
Écart [écart – branche 1] [écart – branche 2]	À l'égard de chaque branche de la transaction, s'il y a lieu, pour les transactions sur dérivés de gré à gré qui prévoient des paiements périodiques (par exemple, swaps fixe-variable, swaps variable-variable, swaps sur marchandises) : • soit l'écart sur le prix établi par référence à un indice de la ou des branches variables, lorsqu'il existe un écart pour une ou plusieurs branches variables (par exemple, USD-LIBOR-BBA plus 0,03 ou WTI moins 14,65 USD) • soit la différence entre les prix établis par référence à un indice de chacune des branches variables (par exemple, l'écart de 9,00 USD pour un swap de référence WCS-WTI lorsque le WCS est évalué à 43 USD et le WTI à 52 USD).	Écart moyen pondéré en fonction du volume.
Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournis à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Somme des marges initiales déposées pour tous les dérivés de la même position.

Marge initiale déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été déposée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée en vertu des obligations des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les contributions à un fonds de défaillance ni les sûretés couvrant les apports de liquidité fournie à la chambre de compensation, c'est-à-dire les lignes de crédit à première demande. Si la marge initiale déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme de valeur totale.	Somme des marges initiales déposées pour tous les dérivés de la même position.
Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale après application de la décote (s'il y a lieu), plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges initiales collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge initiale collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge initiale qui a été collectée par la contrepartie déclarante, y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge initiale collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge initiale, plutôt que de sa variation quotidienne. L'élément de données concerne les transactions non compensées et celles compensées par contrepartie centrale. Dans le cas de ces dernières, il n'inclut pas les sûretés collectées par la chambre de compensation dans le cadre de son activité d'investissement. Si la marge initiale collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges initiales collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation déposées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation déposée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation déposée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles.	Somme des marges de variation déposées pour tous les dérivés de la même position.

	L'élément de données concerne la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation déposée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	
Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (après décote)	La valeur monétaire de la marge de variation qui a été collectée par la contrepartie 1 (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation collectée après application de la décote (s'il y a lieu), établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation déposées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie 1 et présentée sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation collectées pour tous les dérivés de la même position.
Marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (avant décote)	La valeur monétaire de la marge de variation collectée par la contrepartie déclarante (dont celle réglée en espèces), y compris toute marge en transit et en attente de règlement, à moins que l'inclusion de cette marge ne soit pas autorisée aux termes des exigences des autorités compétentes. La marge de variation pour éventualités est exclue. Si la constitution de sûretés est faite au niveau du portefeuille, la marge de variation collectée se rapporte à l'ensemble de ce dernier; si elle l'est au niveau des transactions individuelles, elle se rapporte à elles. Il s'agit de la valeur actuelle totale de la marge de variation, établie sur une base cumulative depuis la première déclaration des marges de variation collectées pour le portefeuille ou la transaction. <u>La convention comptable suivie pour comptabiliser l'instrument ne devrait pas avoir d'incidence sur la marge de variation déposée. En particulier, la marge de variation déposée des instruments réglés au prix du marché (STM) devrait être déterminée conformément aux mêmes principes que ceux applicables aux instruments comptabilisés selon le modèle comptable visant les instruments garantis au prix du marché (CTM).</u> Si la marge de variation collectée est libellée dans plus d'une monnaie, ces montants sont convertis en une seule monnaie choisie par la contrepartie déclarante et présentés sous forme d'une valeur totale.	Somme des marges de variation collectées pour tous les dérivés de la même position.
Montant de valorisation	La valeur actuelle du contrat en cours. Le montant de valorisation est exprimé en coût de sortie du contrat ou de ses composantes, c'est-à-dire le prix auquel il serait vendu (sur le marché dans le cadre d'une transaction en règle normale à la date de valorisation).	La somme des montants de valorisation de tous les dérivés de la position ou la valorisation de la position même si elle est évaluée comme un seul élément.
Date contractuelle de règlement définitif	Date non ajustée prévue par le contrat à laquelle tous les transferts d'espèces ou d'actifs devraient avoir lieu et les contreparties ne devraient plus avoir d'obligations réciproques impayées en vertu du contrat. Pour les produits qui peuvent ne pas avoir de date contractuelle de règlement définitif (par exemple, les options américaines), cet élément de données reflète la date à laquelle le transfert d'espèces ou d'actifs s'effectuerait si la fin avait lieu à la date d'expiration.	Date la plus éloignée parmi toutes les dates contractuelles de règlement définitif pour tous les dérivés de la position.

3 Annexe

Tirée de la version ⁷⁴₂₆ des orientations techniques CDE, *Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*⁷⁴₂₆.

3.1 Montant notionnel

Produit	Montant converti
Options sur actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Contrats à terme sur actions de gré à gré et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix du contrat à terme de gré à gré par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps sur dividendes d'actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice fixé pour la période par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps d'actions, swaps de portefeuille et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Swaps de variance d'actions et produits semblables	Montant de la variance notionnel du véga
Swaps de volatilité d'actions et produits semblables	Montant notionnel du véga
CFD sur actions et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par le nombre d'actions ou de parts indicielles
Options sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix d'exercice par la quantité notionnelle totale
Contrats à terme sur marchandises de gré à gré et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix du contrat à terme de gré à gré par la quantité notionnelle totale
Swaps sur marchandises à taux fixe ou variable et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix fixe par la quantité notionnelle totale
Swaps variable-variable sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du dernier prix au comptant disponible au moment de la transaction comportant l'actif sous-jacent de la branche sans écart par la quantité notionnelle totale de la branche sans écart
Swaptions sur marchandises et produits semblables	Montant notionnel du contrat sous-jacent
CFD sur marchandises et produits semblables	Résultat de la multiplication du prix initial par la quantité notionnelle totale

Notes afférentes au tableau de conversion pour les dérivés négociés en montants non monétaires

Note 1 : pour les dérivés dont l'unité de mesure de la quantité diffère de l'unité de mesure du prix, on convertit le prix ou la quantité totale en une unité de mesure unifiée.

⁷⁴₂₆ Version ³⁴ des orientations techniques CDE, *Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*, https://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20220829.pdf https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf.

Note 2 : si cela s'applique au dérivé, le montant notionnel tient compte des multiplicateurs et des droits d'option.

Note 3 : pour les contrats de type panier, le montant notionnel du dérivé est la somme des montants notionnels de chaque composant du panier.

3.2 Mise en correspondance des valeurs autorisées par la convention de calcul des jours avec les valeurs ISO 20022, FpML et FIX/FIXML

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{75,77}	Valeur du code FIX/FIXML ^{76,78}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{77,79}	Définition FpML
A001	IC30360ISDAor30360AmericanBasisRule	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février, et à condition que la période d'intérêts ait commencé le 30 ^e ou le 31 ^e jour d'un mois donné. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour si la période a commencé le 30 ou le 31 d'un mois donné et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Il s'agit de la méthode 30/360 la plus couramment utilisée pour les obligations américaines classiques et convertibles.	1	30/360 (30U/360 Bond Basis)	Principalement utilisé aux États-Unis avec les règles d'ajustement de date suivantes : 1) si l'investissement est en fin de mois et la Date1 est le dernier jour de février et la Date2 est le dernier jour de février, alors il faut remplacer la Date2 par 30; 2) si l'investissement est en fin de mois et la Date1 est le dernier jour de février, alors il faut remplacer la Date1 par 30; 3) si la Date2 est le 31 et la Date1 est le 30 ou le 31, alors il faut remplacer la Date2 par 30; 4) si la Date1 est le 31, alors il faut remplacer la Date1 par 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f). [Nom symbolique : ThirtyThreeSixtyUS]	30/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e). Le nombre de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 360, calculé selon la formule suivante : base de calcul = $[360 \cdot (A2 - A1) + 30 \cdot (M2 - M1) + (J2 - J1)] / 360$. « J1 » est le premier jour civil, exprimé par une valeur numérique, de la période de calcul ou de la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J1 aura la valeur 30; et « J2 » est le jour civil, exprimé par une valeur numérique, qui suit immédiatement le dernier jour inclus dans la période de calcul ou la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31 et si J1 est supérieur à 29, auquel cas J2 aura la valeur 30 ^{78,80} .

^{75,77} Les informations contenues dans cette colonne renvoient au dictionnaire de données ISO 20022.

^{76,78} La source des informations contenues dans cette chronique est la FIX Trading Community, <http://fiximate.fixtrading.org/latestEP/>.

^{77,79} Les définitions contenues dans le présent document sont protégées par le droit d'auteur de 2006 de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) et sont reproduites avec l'autorisation de l'ISDA. Tous droits réservés.

^{78,80} Notez que l'algorithme défini pour cette fraction du nombre de jours a changé entre les Définitions ISDA 2000 et les Définitions ISDA 2006. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A002	IC30365	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours, d'une manière similaire à la méthode 30/360 (basic rule), et d'une année de 365 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e).					
A003	IC30Actual	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours d'une manière similaire à la méthode 30/360 (basic rule) et le nombre supposé de jours dans une année est calculé d'une manière similaire à la règle Actual/Actual (ICMA). Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Le nombre supposé de jours dans une année est calculé comme le nombre réel de jours dans la période du coupon multiplié par le nombre de paiements d'intérêts dans l'année.					
A004	Actual360	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt et dans une année de 360 jours.	6	Act/360	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 360. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e). [Nom symbolique : ActThreeSixty]	ACT/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (e) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 360.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A005	Actual365Fixed	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt et dans une année de 365 jours.	7	Act/365 (FIXED)	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 365. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d). [Nom symbolique : ActThreeSixtyFiveFixed]	ACT/365. FIXED	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (d) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 365.
A006	ActualActualICMA	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus et du nombre supposé de jours dans une année, c'est-à-dire le nombre réel de jours dans la période de coupon multiplié par le nombre de paiements d'intérêts dans l'année. Si la période de coupon est irrégulière (premier ou dernier coupon), elle est prolongée ou divisée en périodes de quasi-intérêts qui ont la durée d'une période de coupon régulière. Le calcul est alors effectué séparément sur chaque période de quasi-intérêts et les résultats intermédiaires sont additionnés.	9	Act/Act (ICMA)	Le dénominateur est le nombre réel de jours de la période de coupon multiplié par le nombre de périodes de coupon dans l'année. Cette méthode suppose que les coupons réguliers tombent toujours le même jour du mois, lorsque cela est possible. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). [Nom symbolique : ActActICMA]	ACT/ACT. ICMA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (c). Ce code de fractionnement du nombre de jours est applicable aux transactions comptabilisées conformément aux définitions de 2006 de l'ISDA. Les transactions effectuées aux termes des définitions de 2000 de l'ISDA doivent plutôt utiliser le code ACT/ACT.ISMA. Une fraction égale au « nombre de jours courus/nombre de jours dans l'année » au sens de la Règle 251 des statuts, règlements, règles et recommandations de l'International Capital Markets Association (le « Livre des Règles de l'ICMA »), calculée conformément à la Règle 251 du Livre des Règles de l'ICMA telle qu'elle s'applique aux obligations classiques et convertibles non libellées en dollars américains émises après le 31 décembre 1998, comme si le coupon d'intérêt d'une obligation était calculé pour une période de coupon correspondant à la période de calcul ou à la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est

Valeur autori sée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A007	IC30E360orEuroBondBasismodel1	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Toutefois, si le dernier jour de la période du coupon d'échéance est le dernier jour de février, ce jour ne sera pas considéré comme étant équivalent au 30 février. Il s'agit d'une variante de la méthode 30/360 (ICMA) couramment utilisée pour les euro-obligations. L'utilisation de cette variante n'est pertinente que lorsque la fin des périodes de coupon est prévue pour le dernier jour du mois.	5	30E/360 (ISDA)	Les règles d'ajustement des dates sont les suivantes : 1) si Date1 est le dernier jour du mois, il faut remplacer la Date1 par 30; 2) si J2 est le dernier jour du mois (sauf si Date2 est la date d'échéance et si Date2 est en février), il faut remplacer la Date2 par 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (h). [Nom symbolique : ThirtyEThreeSixtyISDA]	30E/360.I SDA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (h). Il convient de noter que l'algorithme de cette fraction du nombre de jours aux termes des définitions de 2006 de l'ISDA est conçu pour donner les mêmes résultats en pratique que la version de la fraction du nombre de jours 30E/360 présentée dans les définitions de 2000 de l'ISDA. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement. Le nombre de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation pour laquelle le paiement est effectué, divisé par 360, calculé sur la base d'une formule comme suit : base de calcul = $[360 \times (A2 - A1) + 30 \times (M2 - M1) + (J2 - J1)] / 360$. « J1 » est le premier jour civil, exprimé par une valeur numérique, de la période de calcul ou de la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J1 aura la valeur 30; « J2 » est le jour civil, exprimé par une valeur numérique, qui suit immédiatement le dernier jour inclus dans la période de calcul ou la période de capitalisation, sauf si ce nombre est 31, auquel cas J2 aura la valeur 30.
A008	ActualActualISDA	Méthode par laquelle l'intérêt est calculé sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt qui tombent dans une année normale, divisé par 365, ajouté au nombre réel de jours dans la période d'intérêt qui tombent dans une année bissextile, divisé par 366.	11	Act/Act (ISDA)	Le dénominateur varie selon qu'une partie de la période de calcul concernée tombe dans une année bissextile. Pour la partie de la période de calcul qui tombe dans une année bissextile, le dénominateur est 366 et pour la partie qui ne tombe pas dans une année bissextile, le dénominateur est 365. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b). [Nom symbolique : ActActISDA]	ACT/ACT. ISDA	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (b). À noter qu'en passant de la recommandation FpML 2.0 à la recommandation provisoire FpML 3.0, le code « ACT/365.ISDA » est devenu « ACT/ACT.ISDA ». Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation pour laquelle le paiement est effectué divisé par 365 (ou, si une partie de cette période de calcul ou de cette période de capitalisation tombe dans une année bissextile, la somme : i) du nombre réel de jours de cette partie de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombant dans une année bissextile, divisé par 366; et ii) du nombre réel de jours de cette partie de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombant dans une année non bissextile, divisé par 365).

Valeur autori sée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A009	Actual365LorActuActubasisRule	Méthode par laquelle l'intérêt est calculé sur la base du nombre réel de jours courus et d'une année de 365 jours (si la date de paiement du coupon ne tombe PAS dans une année bissextile) ou d'une année de 366 jours (si la date de paiement du coupon tombe dans une année bissextile).	14	Act/365L	Le nombre de jours dans une période est égal au nombre réel de jours. Le nombre de jours dans une année est 365, ou 366 si la période se termine dans une année bissextile. Utilisée pour les billets à taux variable en livres sterling. Peut également être appelée Année ISMA. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (i). [Nom symbolique : ActThreeSixtyFiveL]	ACT/365L	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (i). Le nombre réel de jours de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 365 (ou si la dernière date de fin de la période de calcul ou de la période de capitalisation tombe dans une année bissextile, divisé par 366).
A010	ActualActualAFB	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus et d'une année de 366 jours (si le 29 février tombe dans la période de coupon) ou d'une année de 365 jours (si le 29 février ne tombe pas dans la période de coupon). Si une période de coupon est supérieure à un an, elle est divisée en séparant de manière répétitive des sous-périodes d'une année complète en comptant à rebours à partir de la fin de la période de coupon (une année à rebours à partir du 28 février étant le 29 février, le cas échéant). La première des sous-périodes commence à la date de début de la période d'intérêts courus et peut donc être inférieure à un an. Ensuite, le calcul des intérêts est effectué séparément pour chaque sous-période et les résultats intermédiaires sont additionnés.	8	Act/Act (AFB)	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2; le dénominateur est soit 365 (si la période de calcul n'inclut pas le 29 février), soit 366 (si la période de calcul inclut le 29 février). Voir également la Convention-cadre de l'AFB relative aux opérations sur instruments financiers – opérations sur taux d'intérêt (2004), article 4, « Calcul des montants fixes et des montants variables », paragraphe 7, « Base de calcul », alinéa (i). [Nom symbolique : ActActAFB]	ACT/ACT. AFB	Le montant fixe/variable sera calculé selon la fraction du nombre de jours « BASE EXACT/EXACT », comme définie dans les « Définitions communes à plusieurs additifs techniques » publiées par l'Association Française des Banques en septembre 1994. Le dénominateur est soit 365 (si la période de calcul n'inclut pas un 29 février), soit 366 (si la période de calcul inclut un 29 février) – lorsqu'il s'agit d'une période de plus d'un an, deux calculs ou plus sont effectués : les intérêts sont calculés pour chaque année complète, en comptant à rebours à partir de la fin de la période de calcul, et la période initiale restante du talon est traitée conformément à la règle habituelle. Lors du décompte à rebours à cette fin, si le dernier jour de la période concernée est un 28 février, l'année complète doit être décomptée à partir du 28 février précédent, à moins qu'il n'existe un 29 février, auquel cas le 29 février doit être utilisé.
A011	IC30360ICMAor30360basicrule	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, sauf pour le mois de février. Cela signifie qu'un 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant le 28 ^e jour (ou le 29 ^e). Il s'agit de la méthode 30/360 la plus couramment utilisée pour les obligations classiques et convertibles autres qu'américaines émises avant le 1 ^{er} janvier 1999.	4	30E/360 (Eurobond basis)	Également connue sous le nom de 30/360. ISMA, 30S/360, ou méthode allemande spéciale. Les règles d'ajustement des dates sont les suivantes : 1) si la Date1 tombe le 31 ^e jour du mois, elle devient le 30; 2) si la Date2 tombe le 31 ^e jour du mois, elle devient le 30. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (g). [Nom symbolique : ThirtyEThreeSixty]	30E/360	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (g) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (f). Notez que l'algorithme défini pour cette fraction du nombre de jours a changé entre les Définitions ISDA 2000 et les Définitions ISDA 2006. Voir le document Introduction to the 2006 ISDA Definitions pour plus d'informations concernant ce changement.

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A012	IC30E2360orEurobondbasismodel2	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement correspondant au dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois, à l'exception du dernier jour de février dont la valeur du jour du mois est adaptée à la valeur du premier jour de la période d'intérêt si cette dernière est plus élevée et si la période fait partie d'un calendrier régulier. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février d'une année non bissextile est considéré comme étant équivalent au 29 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 29, ou au 30 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois. Le 29 février d'une année bissextile est considéré comme étant équivalent au 30 février lorsque le premier jour de la période d'intérêt est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois. De même si la période de coupon commence le dernier jour de février, elle est supposée produire un seul jour d'intérêt en février comme si elle commençait le 30 février lorsque la fin de la période est le 30 ^e ou le 31 ^e jour du mois, ou deux jours d'intérêt en février lorsque la fin de la période est le 29 février, ou trois jours d'intérêt en février lorsqu'il s'agit du 28 février d'une année non bissextile et que la fin de la période est antérieure au 29.					

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A013	IC30E3360orEurobondbasismodel3	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Il s'agit d'une variante de la méthode 30E/360 (Eurobond basis) selon laquelle le dernier jour de février est toujours considéré comme étant équivalent au 30 février, même s'il s'agit du dernier jour de la période du coupon à l'échéance.					
A014	Actual365NL	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, en excluant tout jour intercalaire du décompte, et d'une année de 365 jours.	15	NL365	Le nombre de jours d'une période est égal au nombre réel de jours, à l'exception des jours intercalaires (29 février) qui ne sont pas pris en compte. Le nombre de jours d'une année est de 365, même en cas d'année bissextile. [Nom symbolique : NLThreeSixtyFive]		
A015	ActualActualUltimo	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours dans la période du coupon divisé par le nombre réel de jours de l'année. Cette méthode est une variante de la méthode ActualActualICMA, à l'exception du fait qu'elle suppose que l'échéance du coupon tombe toujours le dernier jour du mois. Méthode qui correspond à la méthode ACT/ACT.ISMA dans le modèle FpML et à la méthode Act/Act (ICMA Ultimo) dans le modèle FIX/FIXML.	10	Act/Act (ICMA Ultimo)	La méthode Act/Act (ICMA Ultimo) ne diffère de la méthode Act/Act (ICMA) que par le fait qu'elle suppose que l'échéance des coupons réguliers tombe toujours le dernier jour du mois. [Nom symbolique : ActActISMAUltimo]	ACT/ACT. ISMA	Le montant fixe/variable sera calculé conformément à la Règle 251 des statuts, règlements, règles et recommandations de l'International Capital Markets Association, comme publiés en avril 1999 et appliqués aux obligations classiques et convertibles émises après le 31 décembre 1998, comme si le montant fixe/variable était le coupon d'intérêt d'une telle obligation. Ce code de fractionnement du nombre de jours est applicable aux transactions comptabilisées conformément aux définitions de 2000 de l'ISDA. Les transactions effectuées aux termes des définitions de 2006 de l'ISDA doivent plutôt utiliser le code ACT/ACT.ISMA.

Valeur autori sée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{49, 50}	Valeur du code FIX/FIXML L ^{49, 50}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{49, 50}	Définition FpML
A016	IC30EPlus360	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base d'un mois de 30 jours et d'une année de 360 jours. Les intérêts courus jusqu'à une date de règlement du dernier jour d'un mois sont les mêmes que ceux courus jusqu'au 30 ^e jour civil du même mois. Cela signifie que le 31 ^e jour est considéré comme étant le 30 ^e jour et que le 28 février (ou le 29 février pour une année bissextile) est considéré comme étant équivalent au 30 février. Cette méthode est une variante de la méthode 30E360, à ceci près que si l'échéance du coupon tombe le dernier jour du mois, il faut remplacer la valeur de ce jour par « 1 » et augmenter de « 1 » la valeur du mois (c'est-à-dire passer au mois suivant). Cette méthode correspond à la méthode <u>ThirtyEPlusThreeSixty</u> du modèle FIX/FIXML.	13	30E+/360	Variante de la méthode 30E/360. Règles d'ajustement des dates : 1) si la Date1 tombe le 31 ^e jour du mois, il faut la remplacer par le 30; 2) si la Date2 tombe le 31 ^e jour du mois, il faut la remplacer par le 1 ^{er} et augmenter de « 1 » la valeur du Mois2 (Month2), c'est-à-dire passer au mois suivant. [Nom symbolique : ThirtyEPlusThreeSixty]		
A017	Actual364	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, divisé par 364. Cette méthode correspond à la méthode Act364 du modèle FIX/FIXML.	17	Act/364	Le nombre réel de jours entre la Date1 et la Date2, divisé par 364. [Nom symbolique : Act364]		
A018	Business252	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours ouvrables dans la période d'intérêt, divisé par 252. Usage : swaps de devises brésiliens. Cette méthode correspond à la méthode BUS/252 dans le modèle FpML et à la méthode BusTwoFiftyTwo dans le modèle FIX/FIXML.	12	BUS/252	Utilisé pour les swaps libellés en réal brésilien, qui sont basés sur les jours ouvrables au lieu des jours civils. Le nombre de jours ouvrables est divisé par 252. [Nom symbolique : BusTwoFiftyTwo]	BUS/252	Le nombre de jours ouvrables de la période de calcul ou de la période de capitalisation au titre de laquelle le paiement est effectué, divisé par 252.
A019	Actual360NL	Méthode par laquelle les intérêts sont calculés sur la base du nombre réel de jours courus dans la période d'intérêt, en excluant tout jour intercalaire du décompte, et d'une année de 360 jours.	16	NL360	Méthode identique à la méthode Act/360, à ceci près que les jours intercalaires (29 février) ne sont pas pris en compte. [Nom symbolique : NLThreeSixty]		
A020	1/1	Si les parties précisent que la base de calcul est 1/1, alors pour calculer le montant applicable, la valeur « 1 » est simplement introduite dans le calcul comme la base de calcul pertinente. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a).	0	1/1	Si les parties précisent que la base de calcul est 1/1, alors pour calculer le montant applicable, la valeur « 1 » est simplement introduite dans le calcul comme la base de calcul pertinente. Voir également le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a). [Nom symbolique : OneOne]	1/1	Selon le document 2006 ISDA Definitions, article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a) ou le document Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), article 4.16. Day Count Fraction, paragraphe (a).

Valeur autorisée	Nom ISO 20022	Définition ISO 20022 ^{79,81}	Valeur du code FIX/FIXML ^{79,81}	Description de la valeur du code FIX/FIXML	Définition FIX/FIXML	Code FpML ^{79,81}	Définition FpML
NARR	Narrative	Autre méthode			Autres valeurs de code FIX/FIXML non énumérées ci-dessus et valeurs de code FIX/FIXML qui sont réservées aux extensions de l'utilisateur, dans la gamme des valeurs entières de 100 et plus.		

3.3 Méthode de valorisation

Classification des données de valorisation

Catégorie	Données utilisées	Méthode de valorisation ^{79,81}
1	Prix cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou des passifs identiques auxquels l'entité peut avoir accès à la date d'évaluation [IFRS 13:76/ASC 820-10-35-40]. Un prix coté sur un marché actif fournit la preuve la plus fiable de la juste valeur et est utilisé sans ajustement pour évaluer la juste valeur lorsqu'il est disponible, sauf pour quelques cas d'exception. [IFRS 13:77/ASC 820-10-35-41] Un marché actif est un marché sur lequel des transactions portant sur l'actif ou le passif ont lieu avec une fréquence et un volume suffisants pour fournir des informations sur les prix de manière continue. [IFRS 13 : Annexe A/ASC 820-10-20]	Valorisation au prix du marché
2	Prix cotés d'actifs ou de passifs similaires sur des marchés actifs [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-47] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation au prix du marché
3	Prix cotés d'actifs ou de passifs identiques ou similaires sur des marchés qui ne sont pas actifs [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(b)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation selon un modèle – les prix historiques provenant de marchés inactifs ne doivent pas être utilisés directement.
4	Données autres que les prix cotés qui sont observables pour l'actif ou le passif, par exemple les taux d'intérêt et les courbes de rendement observables à des intervalles de cotation courants, les volatilités implicites, les écarts de taux [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(c)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation au prix du marché
5	Les données qui sont principalement dérivées ou corroborées au moyen de données de marché observables par corrélation ou par d'autres moyens (« données corroborées par le marché ») [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(d)] (autres que les prix cotés du marché inclus dans la catégorie 1 qui sont observables pour l'actif ou le passif, directement ou indirectement).	Valorisation selon un modèle – les données peuvent être dérivées « principalement » de données de marché observables, ce qui signifie que des données non observables peuvent être utilisées.
6	Données non observables pour l'actif ou le passif. [IFRS 13:86/ASC 820-10-35-52] Les données non observables sont utilisées pour évaluer la juste valeur dans la mesure où des données observables pertinentes ne sont pas disponibles, ce qui permet de tenir compte des situations dans lesquelles le marché de l'actif ou du passif est peu actif, sinon inactif, à la date d'évaluation. Une entité développe des données non observables en utilisant les meilleures informations disponibles dans les	Valorisation selon un modèle – des données non observables sont utilisées

^{79,81} La classification fournie dans cette colonne est indépendante des normes IFRS 13 et ASC 820 et est utilisée dans le seul but de déclarer les éléments de données critiques des opérations sur dérivés de gré à gré.

circonstances, renseignements qui peuvent inclure les propres données de l'entité, en tenant compte de toutes les informations sur les hypothèses des participants au marché qui sont raisonnablement disponibles. [IFRS 13:87-89/ASC 820-10-35-53 - 35-54A]

3.4 Catégorie de sûreté

Valeur	Nom	Définition
UNCL	Sans sûreté	Il n'y a pas de convention de sûretés entre les contreparties ou la ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent qu'aucun dépôt de sûreté (ni marge initiale ni marge de variation) n'est requis en ce qui a trait à la transaction sur dérivé.
PRC1	Couverture partielle : contrepartie 1 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante ne dépose régulièrement qu'une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
PRC2	Couverture partielle : contrepartie 2 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie ne dépose régulièrement qu'une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
PRCL	Couverture partielle	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que les deux contreparties ne déposent régulièrement qu'une marge de variation au titre de la transaction sur dérivé.
OWC1	Couverture à sens unique : contrepartie 1 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
OWC2	Couverture à sens unique : contrepartie 2 seulement	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose aucune marge au titre de la transaction sur dérivé.
OWP1	Couverture à sens unique/partielle : contrepartie 1	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que la contrepartie déclarante effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que l'autre contrepartie ne dépose régulièrement qu'une marge de variation.
OWP2	Couverture à sens unique/partielle : contrepartie 2	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que l'autre contrepartie effectue le dépôt de la marge initiale et dépose régulièrement une marge de variation et que la contrepartie déclarante ne dépose régulièrement qu'une marge de variation.
FLCL	Couverture entière	La ou les conventions de sûretés entre les contreparties stipulent que les deux contreparties doivent effectuer le dépôt d'une marge initiale et déposer régulièrement une marge de variation au titre de la transaction sur dérivé.

3.5 Déclaration des actions et des événements

On trouve dans le tableau ci-dessous les combinaisons permises de [Type d'action] et de [Type d'événement]. Il y est aussi indiqué si elles s'appliquent au niveau de la transaction, au niveau de la position ou au deux. La dernière colonne du tableau permet de savoir, pour chaque [Type d'action], s'il peut être déclaré sans être accompagné d'un [Type d'événement].

Type d'événement

Type
d'action

Combinaisons de Type d'action et de Type d'événement	Opération (TRAD)	Novation (NOVA)	Compression ou Mesure de réduction du risque (COMP)	Fin par anticipation (ETRM)	Compensation (CLRG)	Exercice (EXER)	Affectation (ALOC)	Compensation et affectation (CLAL)	Événement de crédit (CREV)	Transfert (PTNG)	Événement d'entreprise (CORP)	Mise à niveau (UPDT)	Inclusion dans une position (INCP)	Type d'événement non requis
Nouveau (NEWT)	O	O, P	O		O	O	O	O		O, P	O, P	O ⁸⁰ 82	P	
Modifier (MODI)	O, P	O, P	O	O, P		O	O		O		O, P	O, P	P	P
Corriger (CORR)														O, P
Mettre fin (TERM)		O, P	O	O, P	O	O	O	O	O		O, P		O, P ⁸¹ 83	
Erreur (EROR)														O, P
Relancer (REVI)														O, P
Transférer (PRTO) ⁸² 84										O, P				
Valorisation (VALU)														O, P
Sûretés (MARU)														O, P
Élément de position (POSC)														O

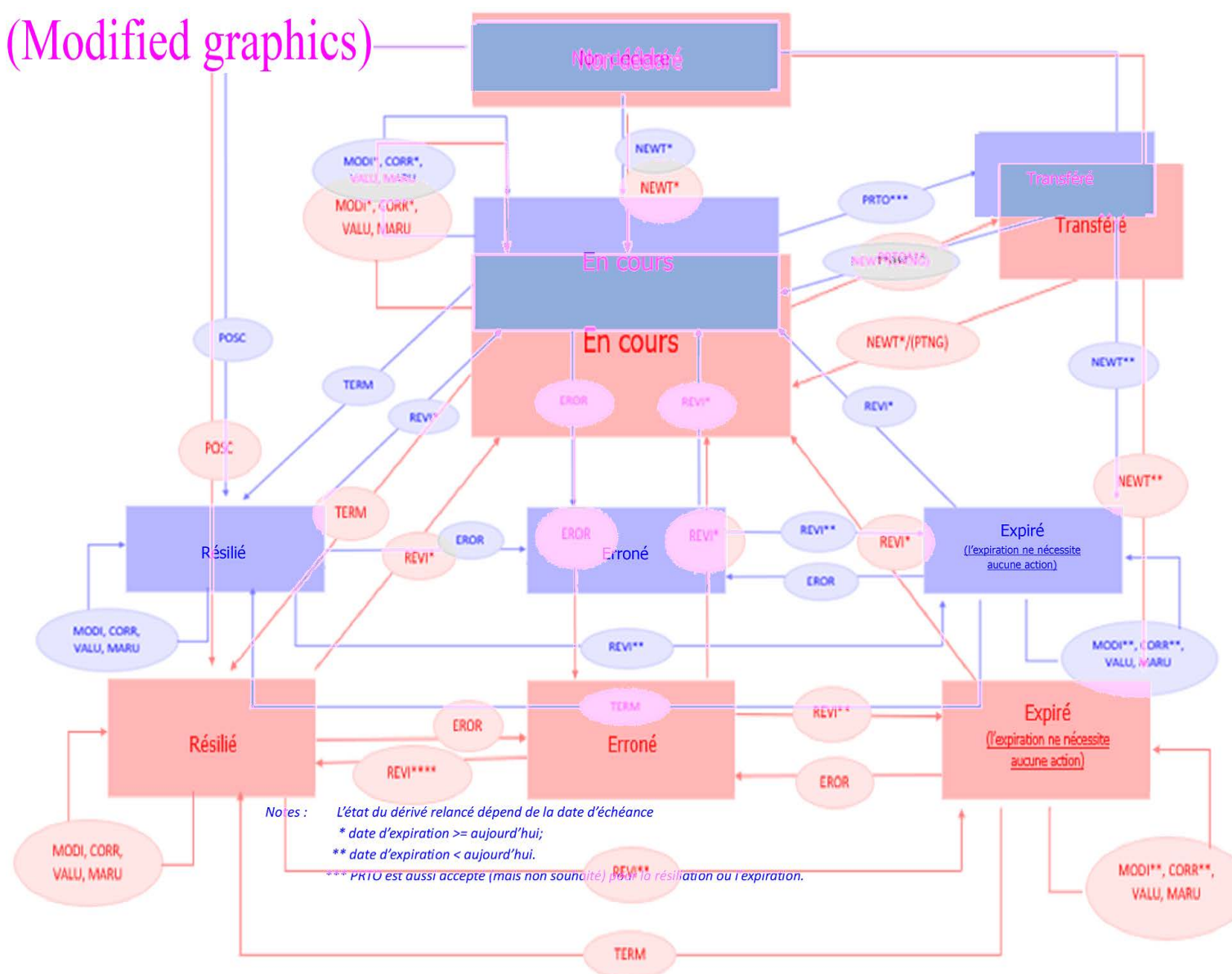
⁸⁰82 NEWT-UPDT s'utilise pour la mise à niveau de swaps « exotiques », « complexes » ou « non génériques » de manière à ce que leur déclaration soit fidèle et conforme au *Manuel technique*.

⁸¹83 Un dérivé qui est ajouté à une position dès qu'il est négocié doit être déclaré au moyen du type d'action « POSC ». En revanche, un dérivé déclaré comme une nouvelle opération qui est ajouté plus tard à une position doit être déclaré au moyen du type d'action « TERM » et du type d'événement « INCP ».

⁸²84 Toute opération active ou inactive (résiliée ou expirée) peut être transférée, sauf si elle a auparavant été déclarée comme une erreur. Une fois qu'une opération est déclarée comme « transférée » à un référentiel central, elle ne peut plus être transmise de nouveau à ce référentiel central, à moins d'être retransférée au même référentiel central. Il faut alors utiliser la combinaison « NEWT-PTNG ».

3.6 Séquence autorisée des actions du cycle de vie

(Modified graphics)



Notes : — L'état du dérivé relancé dépend de la date d'échéance
 * date d'expiration >= aujourd'hui;
 ** date d'expiration < aujourd'hui.
 *** PRTO est aussi accepté (mais non souhaité) pour la résiliation ou l'expiration.
 **** Date de résiliation anticipée déclarée et < aujourd'hui

Les combinaisons de type d'action et de type d'événement facilitent la présentation d'information. La séquence autorisée des actions du cycle de vie vise à éviter les transmissions illogiques. Une transmission pour laquelle le type d'action n'est pas possible

3.7 Définitions des valeurs autorisées pour les types d'événement

Type d'événement	Valeur autorisée	Définition
Opération	TRAD	Création ou modification d'une opération.
Novation/intervention	NOVA	Déplacement sur le plan juridique d'une partie ou de la totalité des risques financiers associés à une transaction, qui passent d'un cédant à un cessionnaire, ce qui a pour effet la fin ou la modification de la transaction initiale de manière à la résilier ou à en modifier le notionnel.
Mesure de réduction du risque postérieure à la transaction	COMP	Compression ou autre mesure de réduction du risque postérieure à l'opération, ayant généralement pour effet la fin ou la modification (c'est-à-dire la réduction de la valeur notionnelle) d'un ensemble de transactions existantes et la création d'un ensemble de transactions nouvelles, et aboutissant pour la contrepartie à une exposition au risque de marché largement identique à celle qui existait avant l'événement.
Fin par anticipation	ETRM	Fin d'une transaction existante avant sa date d'expiration.
Compensation	CLRG	Procédure (compensation centrale) suivant laquelle une contrepartie centrale s'interpose entre les contreparties aux transactions, devenant l'acheteur pour chaque vendeur et le vendeur pour chaque acheteur, garantissant ainsi l'exécution des transactions en cours et ayant pour effet de mettre fin à la transaction existante entre l'acheteur et le vendeur.
Exercice	EXER	Exercice complet ou partiel d'une option ou d'une swaption par l'une des contreparties à la transaction.
Affectation	ALOC	Procédure suivant laquelle des parties d'une ou plusieurs transaction <u>transaction</u> sont attribuées à une ou plusieurs autres contreparties et déclarées comme des transactions nouvelles ^{83 85} .
Compensation et affectation	CLAL	Événement simultané de compensation et d'affectation par une contrepartie centrale.
Événement de crédit	CREV	Événement entraînant la modification ou la fin d'une transaction de crédit précédemment transmise. S'applique uniquement aux dérivés de crédit.
Transfert	PTNG	Procédure suivant laquelle une transaction est transférée à un autre référentiel central et ayant pour effet la clôture de la transaction dans un référentiel central et l'ouverture de la même transaction avec le même UTI dans un référentiel central différent (nouveau).
Inclusion dans la position	INCP	Inclusion d'une transaction compensée par une contrepartie centrale ou d'autres transactions fongibles dans une position à l'occasion de la résiliation d'une transaction existante et de la création d'une nouvelle position ou de la modification du notionnel de la position existante.
Événement d'entreprise	CORP	Processus par lequel une intervention d'entreprise à l'égard d'une action qui est un sous-jacent a une incidence sur les transactions portant sur cette action.

^{83 85} Lorsqu'un dérivé est conclu par un mandataire de contreparties et que l'opération est exécutée avant l'attribution du dérivé aux contreparties représentées par ce mandataire, nous préférons que la contrepartie déclarante ne déclare pas l'opération avant son attribution, mais attende de recevoir l'attribution de la part du mandataire et, une fois celle-ci traitée, déclare uniquement les dérivés attribués, à l'intérieur des intervalles de temps précisés au chapitre 31 des règlements sur la déclaration des opérations. Nous sommes néanmoins disposés à accepter la déclaration des opérations avant attribution de la manière décrite dans le *Manuel technique*; c'est pourquoi nous avons prévu « ALOC » comme valeur autorisée. Voir aussi l'exemple 4.4.

Type d'événement	Valeur autorisée	Définition
Mise à jour	UPDT	Mise à jour d'une transaction en cours en vue d'en assurer la conformité avec les obligations de déclaration modifiées.

3.8 Définitions des valeurs autorisées pour les types d'action

Type d'action	Valeur autorisée	Définition
Nouveau	NEWT	Création de la première transaction donnant naissance à un nouvel UTI.
Modifier	MODI	Modification des modalités d'une transaction précédemment déclarée, en raison d'une modification nouvellement négociée ou l'ajout de renseignements qui n'étaient pas disponibles (par exemple dans le cas d'une transaction à tarification reportée), à l'exception de toute correction d'une transaction déclarée précédemment.
Corriger	CORR	Correction des données erronées d'une transaction déclarée précédemment.
Mettre fin	TERM	Résiliation d'une transaction déclarée précédemment.
Erreur	EROR	Annulation d'une transaction complète déclarée à tort, alors qu'elle n'a jamais pris naissance ou n'était pas soumise aux obligations de déclaration de la législation d'un territoire donné, ou annulation d'une déclaration en double.
Relancer	REVI	Action rétablissant une transaction déclarée avec le type d'action « Erreur », résiliée par erreur ou encore expirée en raison de la déclaration incorrecte de sa date d'expiration.
Valorisation	VALU	Mise à jour de la valorisation d'une transaction. Aucun type d'événement correspondant.
Mise à jour de sûreté/marge	MARU	Mise à jour des données sur les sûretés et les marges. Aucun type d'événement correspondant.
Élément de position	POSC	Déclaration d'une nouvelle transaction qui est incluse dans une déclaration de position distincte le même jour.
Transférer	PRTO	Transfert d'une transaction d'un référentiel central à un autre (changement de référentiel central).

3.9 Valeurs autorisées pour l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »

Pour un « identifiant de sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de suivre les instructions ci-dessous pour les valeurs autorisées mentionnées. Cette liste n'étant pas exhaustive, d'autres types pourraient y être ajoutés.

<u>Catégorie d'actif</u>	<u>Type d'identifiant de sous-jacent</u>	<u>Forme de l'identifiant de sous-jacent si celui-ci ne figure pas dans la source de référence</u>
<u>Taux d'intérêt</u>	<u>Taux variable de référence</u>	<u>Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA</u>
	<u>Identifiant de titres de créance</u>	<u>S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser nom officiel de l'émetteur – date d'échéance – type d'intérêt – taux d'intérêt – fréquence de l'intérêt – rang des titres de créance</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de créance</u>	<u>Nom officiel complet du diffuseur de l'indice</u>
	<u>Indice d'inflation</u>	<u>Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA</u>
<u>Capitaux propres</u>	<u>Nom d'indice de titres de capitaux propres</u>	<u>Nom officiel complet du diffuseur de l'indice</u>
	<u>Identifiant de titres de capitaux propres</u>	<u>S'il n'y a pas de numéro ISIN (p. ex. dans le cas d'un titre non coté), utiliser nom officiel du titre – 2^e caractère de la CFI – 3^e caractère de la CFI</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de capitaux propres</u>	<u>Nom officiel complet du diffuseur de l'indice</u>
<u>Crédit</u>	<u>Identifiant de titre de créance</u>	<u>S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser nom officiel de l'émetteur – date d'échéance – type d'intérêt – taux d'intérêt – fréquence de l'intérêt – rang des titres de créance</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de créance</u>	<u>Nom officiel complet du diffuseur de l'indice</u>
	<u>Identifiant d'entité juridique autre qu'un LEI</u>	<u>Nom d'entité juridique tel qu'il serait consigné dans un registre LEI</u>
<u>Marchandises</u>	<u>Indice sur marchandises</u>	<u>Nom officiel complet du diffuseur de l'indice</u>
	<u>Prix de référence des marchandises</u>	<u>Nom du prix de référence des marchandises (CRP) – ISDA</u>

<u>Catégorie d'actif</u>	<u>Type d'identifiant de sous-jacent</u>	<u>Forme de l'identifiant de sous-jacent si celui-ci ne figure pas dans la source de référence</u>
<u>Autres</u>	<u>Contrat à terme négocié en bourse</u>	<u>S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser code d'identification de marché, code de produit de la place de négociation, contrat à terme de gré à gré et contrat à terme standardisé (F & F), AAAA-MM-JJ et 0</u>
	<u>Option négociée en bourse</u>	<u>S'il n'y a pas de numéro ISIN, utiliser code d'identification de marché, code de produit de la place de négociation, option de vente/d'achat (O & P/C), AAAA-MM-JJ et prix d'exercice de l'option</u>
	<u>Actif numérique</u>	<u>Identifiant de jeton numérique ISO 24165</u>

3.10 Valeurs autorisées pour la source de l'élément de données « Identifiant du sous-jacent (Autre) »

Pour une « source d'identifiant de sous-jacent » qui ne figure pas dans la source de référence, laquelle constitue la source de données de référence pour les énumérations d'identifiants de sous-jacent du fournisseur de services UPI, il convient de suivre les instructions ci-dessous pour les valeurs autorisées mentionnées. Cette liste n'étant pas exhaustive, d'autres types pourraient y être ajoutés.

<u>Catégorie d'actif</u>	<u>Type d'identifiant de sous-jacent</u>	<u>Forme de la source de l'identifiant de sous-jacent</u>
<u>Taux d'intérêt</u>	<u>Taux variable de référence</u>	<u>Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA</u>
	<u>Identifiant de titres de créance</u>	<u>Nom et type des titres de créance selon le CDE</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de créance</u>	<u>Nom officiel du diffuseur</u>
	<u>Indice d'inflation</u>	<u>Nom de l'option à taux variable (FRO) – ISDA</u>
<u>Capitaux propres</u>	<u>Nom d'indice de titres de capitaux propres</u>	<u>Nom officiel du diffuseur</u>
	<u>Identifiant de titres de capitaux propres</u>	<u>Nom et type de titre selon le CDE</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de capitaux propres</u>	<u>Nom officiel du diffuseur</u>
<u>Crédit</u>	<u>Identifiant de titres de créance</u>	<u>Nom et type de titre selon le CDE</u>
	<u>Identifiant d'indice de titres de créance</u>	<u>Nom officiel du diffuseur</u>
	<u>Identifiant d'entité juridique autre qu'un LEI</u>	<u>Nom de l'entité</u>
<u>Marchandises</u>	<u>Indice sur marchandises</u>	<u>Nom officiel du diffuseur</u>
	<u>Prix de référence des marchandises</u>	<u>Nom du prix de référence des marchandises (CRP) – ISDA</u>
<u>Autres</u>	<u>Contrat à terme négocié en bourse</u>	<u>Toutes formes</u>
	<u>Option négociée en bourse</u>	<u>Toutes formes</u>
	<u>Actif numérique</u>	<u>Identifiant de jeton numérique ISO 24165</u>

4 Exemples

4.1 Transactions sur plateforme d'exécution de swaps – anonymes et compensées

Cet exemple illustre la déclaration de transactions anonymes qui sont compensées par la suite.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Horodatage de la réception pour compensation	Identifiant de l'initiateur	Contrepartie centrale	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2	Compensé	Identifiant de la plateforme
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	NULL	LEI1SEF0001	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
2	TERM	CLRG	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1SEF0001 LEI1CCP0004	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
3	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001BETA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI2CP0002	Y	NULL
4	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001GAMMA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1RPT0001	Y	NULL

4.2 Paquet – prix/écart

Cet exemple illustre la déclaration de paquet de dérivés ~~fondées~~fondée soit sur le prix soit sur l'écart.

Rangée 1 : transmission d'un nouveau paquet de dérivés alors que le prix du paquet de dérivés n'est pas encore connu.

Rangée 2 : modification du paquet de dérivés pour la mise à jour du prix du paquet de dérivés.

Rangée 3 : transmission d'un nouveau paquet de dérivés avec un écart de paquet de dérivés.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Indicateur de paquet de dérivés	Identifiant de paquet de dérivés	Prix du paquet de dérivés	Monnaie du prix du paquet de dérivés	Notation du prix du paquet de dérivés	Écart du paquet de dérivés	Monnaie de l'écart du paquet de dérivés	Notation de l'écart du paquet de dérivés	Prix	Monnaie du prix	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001EEE	Vrai	ABCD12	99999,99999999999999	NULL	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	2023-04-05T16:14:36Z	LEI1RPT0001EEE	Vrai	ABCD12	3.2	CAD	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	Vrai	ABCD 34	NULL	NULL	NULL	200	NULL	4	20.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.3 Résiliation/modification partielle, correction

Cet exemple illustre l'utilisation de différentes combinaisons de types d'action et d'événement pour la déclaration de changements subis par une transaction déclarée précédemment.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Date d'expiration	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Type d'option incorporée	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	Vrai	2023-04-02T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	MODI	TRAD	FALSE Faux	2023-04-03T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		OPET	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
4	CORR			2023-04-04T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		EXTD	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.4 Affectation (ALOC)

Cet exemple illustre la déclaration des transactions d'affectation avant négociation et après négociation.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
2	TERM	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
3	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST1	LEI1RPT0001PREAA	4000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A1
4	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST2	LEI1RPT0001PREAA	6000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A2

4.5 Position

Cet exemple illustre la déclaration d'un dérivé à l'occasion de son inclusion dans une position.

Rangées 1 et 2 : déclaration d'un nouveau dérivé qui est à l'origine d'une nouvelle position le même jour ([transaction d'achat](#)).

Rangée 3 : transmission de messages de valorisation de fin de journée au niveau de la position.

Rangées 4-~~et~~ 5 [et 6](#) : déclaration d'un nouveau dérivé inclus dans une position le même jour ([transaction d'achat et de vente](#)).

Rangées ~~6-7-et~~ 8, 9, 10 et 11 : déclaration d'un nouveau dérivé ([autre façon de déclarer une opération](#)) inclus dans une position le lendemain ([transaction d'achat](#)) (ce qui signifie que les messages de valorisation devront être envoyés à la fois pour LEI1RPT0001TRAD3 et LEI1RPT0001POSC1 le 8 janvier 2023).

[Rangée 12](#) : depuis l'inclusion, le 9 janvier 2023, de l'identifiant LEI1RPT0001TRAD3 dans la position LEI1RPT0001POSC1, seul un message de valorisation doit être transmis pour la position LEI1RPT0001POSC1.

[Rangée 13](#) : déclaration des transactions de vente devant être incluses dans la position LEI1RPT0001POSC1.

~~Rangées 9 et 10~~[Rangée 14](#) : déclaration d'une fin par anticipation au niveau de la position en raison de transactions de vente.

[Rangée 15](#) : transmission de messages de valorisation de fin de journée au niveau de la position.

Rangée ~~11~~ : ~~maintien d'une position ouverte et~~[16](#) : déclaration ~~quotidienne d'une valeur de contrat nulle~~[des transactions de vente devant être incluses dans la position LEI1RPT0001POSC1](#).

Rangée ~~42~~¹⁷ : fin d'une position.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant d'événement	UTI	UTI de la position subséquente	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1	Contrepartie 2	Niveau	Identifiant de l'acheteur	Identifiant du vendeur	Montant de valorisation	Prix ⁸⁶
1	POSC		2023-01-05T14:02:34Z ¹⁷ 2023-01-05T14:01:34Z		LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1.0001 000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	NEWT	INCP	2023-01-05T14:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1.0001 000	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
3	VALU		2023-01-05T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1.0001 000	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	1.245.168	
4	POSC		2023-01-07T08:01:34Z		LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	500600	2023-01-06T12:07T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		13
5	POSC		2023-01-07T08:02:34Z		LEIRPT0001TRAD8	LEIRPT0001POSC1	100	2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13
5 ⁶	MODI	INCP	2023-01-07T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1.5001 500	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.333
6 ⁷	NEWT	TRAD	2023-01-08T18:08T09:01:34Z ¹⁷ 2023-01-08T09:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	—	14
8	VALU		2023-01-08T18:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	23	
9	VALU		2023-01-08T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1.500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	65	
7 ¹⁰	TERM	INCP	2023-01-09T18:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	.	14
8 ¹¹	MODI	INCP	2023-01-09T18:02:34Z		LEIRPT0001POSC1		2.2002 200	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
9 ¹²	MODI VALU	ETRM	2023-01-10T15:09T18:01:34Z ¹⁷ 2023-01-10T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1.0002 200	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	71.02	
13	POSC		2023-01-10T15:01:34Z		LEIRPT0001TRAD4	LEIRPT0001POSC1	1.200	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.50
10 ¹⁴	MODI	ETRM	2023-01-11T11:10T15:01:34Z ¹⁷ 2023-01-11T15:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		01 000	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
11 ¹⁵	VALU		2023-01-11T18:10T18:01:34Z ¹⁷ 2023-01-11T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		01 000	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	078	
16	POSC		2023-01-11T11:01:34Z		LEIRPT0001TRAD5	LEIRPT0001POSC1	1.000	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.75
12 ¹⁷	TERM	ETRM	2023-01-12T15:11T11:01:34Z ¹⁷ 2023-01-11T11:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T09:05T08:01:34Z ¹⁷ 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

4.5a Position intrajournalière

Cet exemple illustre des opérations intrajournalières lorsque la position nette de fin de journée est de 0.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	UTI	UTI de la position subséquente	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1	Contrepartie 2	Niveau	Identifiant de l'acheteur	Identifiant du vendeur	Montant de valorisation	Prix ⁸⁷
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1.000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	POSC		2023-01-05T010:45:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	400	2023-01-05T010:45:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12.44
3	POSC		2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12.58
4	NEWT	INCP	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		0

⁸⁶ Les valeurs de prix dans cet exemple sont données à titre indicatif seulement et varient en fonction de la méthode de calcul utilisée.

⁸⁷ Ibid.

5	TERM	ETRM	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		
-------------------	----------------------	----------------------	--------------------------------------	---------------------------------	--	-------------------	--------------------------------------	----------------------------	---------------------------	----------------------	----------------------------	---------------------------	--	--

4.6 Erreur et relance

Cet exemple illustre le cas d'un dérivé comptabilisé par erreur, puis résilié, mais qui doit être relancé parce que résilié par erreur.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Indicateur de modification	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	UTI antérieur (pour les relations d'une à une et d'une à plusieurs entre les transactions)	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	EROR			2023-04-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	REVI			2023-04-05T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.7 Dérivé sur cryptoactifs

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Dérivé sur cryptoactifs Indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 1	Indicateur de cryptoactif sous-jacent – branche 2	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Identifiant unique de produit	Montant notionnel	Horodatage de l'exécution	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2
1	NEWT	TRAD	Vrai	Faux	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG	JESXGGQZ8VLPDHMT5	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.8 Mise à niveau

Cet exemple illustre la déclaration d'un événement de type « Mise à niveau », destiné à assurer la conformité avec des obligations de déclaration modifiées.

Rangée 1 : Exécution d'un nouveau dérivé le 2023-04-01.

Rangée 2 : Mise en application de nouvelles obligations de déclaration; déclaration du dérivé existant comme « Modifier-Mise à niveau » (MODI-UPDT) pour assurer la conformité aux nouvelles exigences⁸⁴⁸⁸.

Rangée	Type d'action	Type d'événement	Horodatage de l'événement	Identifiant unique de transaction (UTI)	Montant notionnel	Méthode de valorisation	Horodatage de l'exécution	Catégorie de sûreté	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Contrepartie 2	Identifiant de la plateforme	Compensé
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MarkToMarket	2023-04-01T14:15:36Z	FULLY	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	NULL	N
2	MODI	UPDT	2024-05-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MTMA	2023-04-01T14:21:36Z	FLGL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	BILT	N

⁸⁴⁸⁸ Veuillez noter que l'exemple présenté ne constitue pas une liste exhaustive des champs touchés par les obligations de déclaration modifiées. Nous vous recommandons donc de consulter la règle pour connaître tous les champs qui peuvent être touchés.

Summary report: Litera Compare for Word 11.11.0.158 Document comparison done on 2026-07-28 17:04:18	
Style name: Default Style	
Intelligent Table Comparison: Active	
Original filename: 91-507 Derivatives Data Technical Manual_11-07-24_QF.docx	
Modified filename: 91-507 Revised Derivatives Data Technical Manual_10-07-26_QF.docx	
Changes:	
Add	690
Delete	580
Move From	0
Move To	0
Table Insert	51
Table Delete	16
Table moves to	0
Table moves from	0
Embedded Graphics (Visio, ChemDraw, Images etc.)	1
Embedded Excel	0
Format changes	0
Total Changes:	1338



Canadian Securities Administrators
Autorités canadiennes en valeurs mobilières

CSA Multilateral Notice of Publication

Changes to Companion Policy 96-101 *Derivatives: Trade Reporting* and Policy Statement to Regulation 91-507 *Respecting Trade* *Repositories and Derivatives Data Reporting*

August 11, 2026

Introduction

Today, the securities regulatory authorities of the Canadian Securities Administrators (the **CSA**) in Québec, Alberta, British Columbia, New Brunswick, Newfoundland and Labrador, Northwest Territories, Nova Scotia, Nunavut, Prince Edward Island, Saskatchewan, and Yukon (collectively, the **Participating Jurisdictions** or **we**) are announcing changes to:

- *Policy Statement to Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting (Policy Statement 91-507)*, and
- Companion Policy 96-101 *Derivatives: Trade Reporting (96-101CP)*.

These changes will take effect on August 11, 2027.

Substance and Purpose

Policy Statement 91-507 and 96-101CP are being changed to provide market participants with an updated version of the CSA derivatives data technical manual (the **Manual**). The changes to the Manual include updated technical specifications regarding the definition, format and allowable values for each data element that is required to be reported under *Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting*, in Québec, and Multilateral Instrument 96-101 *Derivatives: Trade Reporting* in the other Participating Jurisdictions. These changes are intended to improve the standardization and harmonisation of data elements.

Background

A first version of the Manual was published on July 25, 2024.

Staff expect to make changes to the Manual on a periodic basis, including changes to reflect revisions to technical specifications made by international standards-setting organizations and regulatory authorities.

-2-

Summary of Changes

The substance of the changes made to the Manual are set out in the Annexes attached to this Notice:

- Annex A: For Québec - Changes to Policy Statement 91-507
- Annex B: For the other Participating Jurisdictions - Changes to 96-101CP
- Annex C: For all Participating Jurisdictions - the blacklined version of the Manual identifying the changes

Questions

We welcome questions or comments on an ongoing basis.

Please refer your questions to any of the following:

Yasmine Garreau

Senior Policy Analyst
Markets and Derivatives Oversight and
International Affairs
Autorité des marchés financiers
yasmine.garreau@lautorite.qc.ca

Janice Cherniak

Senior Legal Counsel
Alberta Securities Commission
janice.cherniak@asc.ca

Michael Brady

Deputy Director, CMR
BC Securities Commission
mbrady@bcsc.bc.ca

Doug Harris

General Counsel, Director of Market
Regulation and Policy and Secretary
Nova Scotia Securities Commission
doug.harris@novascotia.ca

Caroline Smith

Senior Legal Counsel
Financial and Consumer Affairs Authority of
Saskatchewan
caroline.smith@gov.sk.ca

Ray Burke

Responsable, Financement des sociétés
Commission des services financiers et des
services aux consommateurs du
Nouveau-Brunswick
ray.burke@fcnb.ca

Annex A

CHANGES TO POLICY STATEMENT TO REGULATION 91-507 RESPECTING TRADE REPOSITORIES AND DERIVATIVES DATA REPORTING

1. Appendix A of *Policy Statement to Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting* is replaced with the following:

“Appendix A

CSA Derivatives Data Technical Manual

**Technical specifications for over-the-
counter derivatives data reporting**

August 11, 2026

Version 2.0

Document History

Revisions

Date	Version	Description
7/25/2024	1.0	First publication along with amendments to the TR Rules.
8/11/2026	2.0	Second publication with revisions

Table of Contents

1	INTRODUCTION	5
1.1	Background	5
1.1.1	Format of technical specifications	5
1.2	Explanation of Certain Data Elements or Categories	7
1.2.1	Direction of the transaction	7
1.2.2	Repeating data elements or leg-based products	7
1.2.3	Schedules	7
1.2.4	Actions and Events	8
1.2.5	Validations	8
1.2.6	Underlier ID (Other) fields	9
1.2.7	Other payment fields	10
1.2.8	Packages	10
1.2.9	Position reporting	10
1.2.10	Prior UTI	10
1.3	Historical Derivatives	11
2	TECHNICAL SPECIFICATIONS	12
2.1	Position reporting guidelines	57
3	APPENDIX	62
3.1	Notional amount	62
3.2	Mapping of Day count convention allowable values to ISO 20022, FpML, and FIX/FIXML values	63
3.3	Valuation method	71
3.4	Collateralisation category	72
3.5	Action and event reporting	72

3.6	Allowable Action Type Sequences	74
3.7	Definitions for Event Type Allowable Values	75
3.8	Definitions for Action Type Allowable Values	76
3.9	Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other)	77
3.10	Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other) source	78
4	EXAMPLES	79
4.1	SEF Transactions – Anonymous and cleared	79
4.2	Package- Price/Spread	79
4.3	Partial Termination/Amendment, Correction	80
4.4	Allocation	80
4.5	Position	80
4.5a	Position – intraday	81
4.6	Error and Revive	82
4.7	Crypto	83
4.8	Upgrade	83

1 Introduction

1.1 Background

The technical specifications in this CSA Derivatives Data Technical Manual (the **Technical Manual**) specify the definition, format, and allowable values for each data element that is required to be reported under Manitoba Securities Commission Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting*, Ontario Securities Commission Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting, Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting* (Québec) and, in the remaining provinces and territories, Multilateral Instrument 96-101 *Derivatives: Trade Reporting* (collectively, the **TR Rules**) and are sourced primarily from the *Revised CDE Technical Guidance - version 4: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*¹ (the **CDE Technical Guidance**).

The Technical Manual is intended to assist market participants in reporting under amendments to the TR Rules that came into effect on July 25, 2025.

All terms in the Technical Manual that are defined in a TR Rule have the same meaning as in the applicable TR Rule, unless otherwise provided in the Technical Manual or unless the context otherwise requires.

Where data elements align with the data elements prescribed by the Commodity Futures Trading Commission (the **CFTC**), the Technical Manual has generally adopted the name, definition, format, and allowable values as set out by the CFTC.

It is expected that the Technical Manual will be updated on a periodic basis to reflect updates from the Canadian Securities Administrators (**CSA**) and international updates.

1.1.1 Format of technical specifications

- (1) **#:** all data elements are assigned a number for ease of reference. The data element number is referenced throughout the Technical Manual and in Appendix A to each of the TR Rules.
- (2) **Source:** this column contains "CDE", "CSA", "CFTC" or "ESMA". "CDE" refers to a data element in the CDE Technical Guidance. "CFTC" refers to a data element sourced from the Commodities Futures Trading Commission. "ESMA" refers to a data element sourced from the European Securities and Markets Authority.
- (3) **Category:** data elements are grouped by topic or category.
- (4) **Data Element Description:** a concise description of the data element that is set out in Appendix A to each of the TR Rules and reproduced in the Technical Manual for convenience. These descriptions are intended to comply with CSA rule drafting standards while substantively aligning with the corresponding detailed explanation.
- (5) **Detailed Explanation of Data Element:** for CDE data elements, the explanation is sourced from the CDE Technical Guidance, with footnotes added to provide clarity based on the CFTC's regulations. For CFTC data elements, the explanation is sourced from the CFTC Technical Specification, with footnotes added to provide clarity. For ESMA data elements, the explanation is sourced from EMIR REFIT validation rules. Data elements sourced from the CFTC and ESMA apply regardless of reporting requirements in the U.S. or Europe. For example, data elements sourced from the CFTC apply to all derivatives that are required to be reported under the TR Rules, as applicable, and not only to swaps under CFTC rules. Further, they apply under the TR Rules regardless of whether the derivative is otherwise required to be reported under CFTC rules.
- (6) **Format:** see Table below that illustrates the meaning of formats used throughout the document.

¹ See Revised CDE Technical Guidance – version 4 - Harmonisation of critical OTC derivative data elements (other than UTI and UPI), December 2025, https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf

Format	Content in brief	Additional Explanation	Example(s)
YYYY-MM-DD	Date	YYYY = four-digit year MM = two-digit month DD = two-digit day	2015-07-06 (corresponds to 6 July 2015)
YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Date and time	YYYY, MM, DD as above hh = two-digit hour (00 through 23) (am/pm NOT allowed) mm = two-digit minute (00 through 59) ss = two-digit second (00 through 59) T is fixed and indicates the beginning of the time element. Z is fixed and indicates that times are expressed in UTC (Coordinated Universal Time) and not in local time.	2014-11-05T13:15:30Z (corresponds to 5 November 2014, 1:15:30 pm, Coordinated Universal time, or 5 November 2014, 8:15:30 am US Eastern Standard Time)
Num(25,5)	Up to 25 numerical characters including up to five decimal places	The length is not fixed but limited to 25 numerical characters including up to five numerical characters after the decimal point. Should the value have more than five digits after the decimal, reporting counterparties should round half-up.	1352.67 12345678901234567890.12345 1234567890123456789012345 0 - 20000.25 - 0.257
Num(5) ²	Up to five numerical characters, no decimals are allowed	The length is not fixed but limited to five numerical characters	12345 123 20
Char(3)	Three alphanumeric characters	The length is fixed at three alphanumeric characters.	USD X1X 999
Varchar(25)	Up to 25 alphanumeric characters	The length is not fixed but limited at up to 25 alphanumeric characters. No special characters are permitted. If permitted, it would be explicitly stated in the format of the data element.	asgaGEH3268EFdsagtTRCF543 aaaaaaaaa x
Boolean	Boolean characters	Either "True" or "False" or "true" or "false" ³	True / true False / false

Table 1 – Explanation of formats used in the Technical Specification

² Num(5) format is equivalent to Num(5,0) used in this Technical Manual and does not allow decimals.³ Both upper case and lower case are allowed until the ISO 20022 message standard is adopted by CSA.

1.2 Explanation of Certain Data Elements or Categories

1.2.1 Direction of the transaction

The Technical Manual requires the reporting of Buyer/Seller or Payer/Receiver for this data element. This is a slightly different approach from that taken in the CDE Technical Guidance, which provides two options for reporting Direction. The reporting counterparty should not report both Buyer/Seller and Payer/Receiver for a given transaction, but instead use the reporting method appropriate for the type of instrument reported.

1.2.2 Repeating data elements or leg-based products

Depending on the product being reported and the related market convention, a multi-leg or multi-stream product could be reported using a particular data element more than once. Unless the data element is listed as "leg", it cannot be reported more than once. For products where the multi-leg or multi-stream concept is not applicable, report values in the designated data element for the first leg (Leg 1) for all fields that are specified as leg-based data elements. For products having two legs where one leg references a fixed value and the other leg references a floating value, Leg 1 elements should refer to the leg that references a fixed value and Leg 2 elements should refer to the leg that references a floating value. For products having two legs where each leg references a floating value respectively, the legs should be ordered based on the alphabetical ordering of the names of the respective underliers. In cases where the names of the respective underliers are the same, but they are differentiated by a tenor, Leg 1 elements should refer to the leg referencing the underlier with the shorter tenor.

1.2.3 Schedules

Derivatives involving schedules are required to be reported as part of creation data if the details are known at the time of execution, or as part of a lifecycle event when the scheduled values become known during the life of the transaction. Fields that require reporting of multiple values in a single field can be reported using a delimiter between the reported values. The choice of delimiter is left to the discretion of the trade repository; however, the same delimiter must be used consistently across all files. The format and allowable values listed in Table 2 apply to each individual value within a scheduled field, rather than the delimited field. Each entry must independently meet the format and validation rules applicable to the data element.

When schedule fields are populated, they must contain the same number of entries across all related fields, and the entries must be ordered chronologically by effective date. Public dissemination is required for the first 10 values in schedule fields.

The following data elements permit the reporting of multiple values:

- 10 Jurisdiction of Counterparty 1
- 11 Jurisdiction of Counterparty 2
- 37 Notional quantity schedule - effective date
- 38 Notional quantity schedule - end date
- 39 Notional quantity schedule - notional quantity
- 40 Notional amount schedule - notional amount
- 41 Notional amount schedule - effective date
- 42 Notional amount schedule - end date
- 50 Price schedule – effective date
- 51 Price schedule – end date
- 52 Price schedule – price
- 65 Strike price schedule – effective date
- 66 Strike price schedule – end date
- 67 Strike price schedule – strike price
- 77 Clearing exceptions and exemptions - Counterparty 1
- 78 Clearing exceptions and exemptions – Counterparty 2
- 124 Basket constituent identifier
- 125 Basket constituent identifier source
- 126 Basket constituent number of units
- 127 Basket constituent unit of measure
- 136 Other payment amount
- 137 Other payment currency
- 138 Other payment date
- 139 Other payment payer
- 140 Other payment receiver
- 141 Other payment type

1.2.4 Actions and Events

Appendix 3.5 illustrates how different events should be reported in transaction reporting, position reporting and end-of-day (valuation and collateral) reporting.

At a minimum, any data elements that are impacted as part of actions and events should be reported. It is at the trade repository's discretion whether other elements should be included for event message types.

Corrections of valuation and collateral are allowed and should be reported using "VALU" and "MARU" action types.

1.2.5 Validations

Validations are generally intended to be the same as the CFTC's as specified in its Part 45 swap data reporting requirements when the Technical Manual data element is also required by the CFTC. A trade repository may limit the number of data elements required to be submitted for Action Type TERM, PRT0, and EROR.

Reporting Types:

Transaction = Creation data and Lifecycle Event data: Transaction means entering into, assigning, selling or otherwise acquiring or disposing of a derivative or the novation of a derivative. Each transaction must be reported as a unique derivative under the TR Rules.

Valuation= Valuation Data: Valuation data means data that reflects the current value of the derivative and includes the data in the elements listed in Appendix A under the heading "Data Elements Related to Valuation".

Collateral = Margin Data: Collateral and margin data means data that reflects the current amount of collateral and margin posted or collected as described in the elements listed in Appendix A under the heading "Data Elements Related to Collateral and Margin".

Values:

M=Mandatory (The data element is mandatory and any additional validation rules, if specified, must also be followed)

C= Conditional (The data element is required if the conditions set out in the validation rules are fulfilled. Additional validation rules, if specified, must also be followed)

NR= Not Required (The data element is not required to be included in the report)

O= Optional (The data element should be reported **if applicable** to the derivative. Additional validation rules, if specified, may be applied when populated)

Example:

“Transaction - C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank}” means

Transaction - C (Conditional):

This field is **M (Mandatory)** if both **[Payer identifier]** and **[Receiver identifier]** are **not populated**. Otherwise, leave it **blank**.

“Transaction - C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {optional}” means

Transaction - C (Conditional):

This field is **M (Mandatory)** if both **[Payer identifier]** and **[Receiver identifier]** are **not populated**. Otherwise, the field is **O (Optional)** (i.e., it may be included if applicable to the derivative).

Leg-based data elements:

If a data element is leg-based and Table 2 does not provide leg-specific validations, the validations are intended to apply to the first leg (Leg 1) by default. However, it should not be presumed that the same validations apply to the second leg (Leg 2). This is largely due to the conditionality between leg fields and the fact that trade repository specific data elements may affect how published validations operate in ways not contemplated in the Technical Manual. Given this, trade repositories may incorporate additional validations for leg-level data elements where they deem it necessary.

1.2.6 Underlier ID (Other) fields

Data elements related to underlying asset:

This set of data elements captures information related to underliers when the information cannot be derived from the UPI. These data elements apply to all asset classes and should support any underliers.

- Data elements 128 and 129 should be reported when the UPI service provider does not support the identifier and its source for a particular underlier. When not supported, both ‘Underlier ID’ and ‘Underlier ID source’, or their equivalent attributes, are assigned the value as ‘OTHER’ by either the submitter or the UPI service provider. Below is some guidance for allowable values to use.
 - o **Underlier IDs not in Golden Source:** For an ‘Underlier ID’ or ‘Underlier ID Source’ not present in the golden source, which serves as the reference data source for the UPI service provider’s enumerations of Underlier IDs, refer to Table 9 and Table 10 in the Annex for predefined allowable values, which are not exhaustive, and other types may be included.
 - o **Underlier ID in Golden source but not yet in UPI enumeration list:** For an ‘Underlier ID’ that exists in the golden source but is not yet included in the UPI service provider’s enumeration list (i.e. due to a lag between the creation of a new ‘Underlier ID’ in the golden source and its addition to the enumeration list), the allowable value should be the value as it exists in the golden source.
- Data elements 130 and 131 are necessary to determine the price of an underlier asset or index that cannot be derived from the given UPI.
- Data element 121 is necessary to easily identify the derivative transactions based on crypto assets that cannot be identified from the given UPI.

1.2.7 Other payment fields

The set of data elements related to other payments can be reported multiple times in the case of multiple payments. If other payments are made in instalments, the entire schedule of payments is reported.

1.2.8 Packages

Package identifier should be used by reporting counterparties or entities responsible for reporting as a unique link between reports belonging to the same derivative contract, where the table of fields does not enable submitting the details in only one report and where the package transaction is composed of a combination of derivative contracts that are negotiated together as the product of a single economic agreement.

If a derivative contract ceases to exist, but gives rise to another derivative, those two contracts should be considered individually and not be reported as a package transaction, thus no package identifier should be used to link those reports in such circumstance, while at the same time the field 'Prior UTI' should be reported.

The reporting field 'Package transaction price' and 'Package transaction price currency' should be populated with the relevant price and currency for the entire package transaction rather than the price and currency of the individual components. If the individual components have individual prices and currencies, those should be populated in the relevant report in field 'Price' and 'Price currency' in addition to the population of the field 'Package transaction price'.

1.2.9 Position reporting

Position reporting is an optional method of reporting for derivatives that meet the requirements under section 33.1 of the TR Rules. The "Position Reporting guidelines" in section 2.1 sets out how to report lifecycle events in relation to certain data elements. Lifecycle events may be reported at the position level in respect of all relevant data elements where derivatives meet these conditions. Refer to example 4.5 to review how positions are to be reported.

Positions may not be reported without previously reporting the derivatives separately at transaction level. Derivatives at transaction level should be updated to have an appropriate status, so that it is clear that they are no longer open and to avoid double-counting of the derivatives that were included in positions. The reporting counterparty should report the terminations of all the derivatives at transaction level that enter into the position. For new derivatives that are included in the position on the same day, action type "POSC" with no event type should be used. For derivatives that are included in the position on all other days, action type "TERM" and event type "INCP" should be used.

Where a position valuation becomes zero, there are only two possible ways to proceed:

- Termination of the position and reporting of a new one using a different UTI at a later stage. No valuations are reported between the termination of the first position and the creation of the latter.
- Maintaining the position open and reporting a zero contract value on a daily basis.

1.2.10 Prior UTI

Prior UTI should be assigned to the predecessor derivative that has given rise to the reported derivative due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between derivatives. This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between derivatives (e.g., in the case of a compression). In particular, the prior UTI will be applicable in the following events:

- Full or partial novation (reported with Action Type: NEWT and Event Type: NOVA and includes Prior UTI)
- Clearing
- Exercise (in the case of swaptions)
- Allocation (reported with Action Type: NEWT and Event Type: ALOC and includes Prior UTI)

1.3 Historical Derivatives

Counterparties should not create a new UTI for outstanding derivatives, even if the original UTI is not fully compliant with e.g., new format requirements under the Technical Manual. For existing derivatives that utilize a USI (Unique Swap Identifier), the trade repository can allow for these to be submitted in a separate data element.

All existing derivatives should eventually be updated with the new data requirements and reported using the action field Modify (MODI) and event type Upgrade (UPDT).

2 Technical Specifications

Data Elements Related to Counterparties

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
1	CDE	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Identifier of the reporting counterparty.	Identifier of the counterparty to an OTC derivative transaction⁴ who is fulfilling its reporting obligation via the report in question. In jurisdictions where both parties must report the transaction, the identifier of Counterparty 1 always identifies the reporting counterparty. In the case of an allocated derivative transaction executed by a fund manager on behalf of a fund, the fund and not the fund manager is reported as the counterparty. However, if the allocation to specific funds does not take place prior to the reporting deadline, then the fund manager executing the transaction on behalf of the fund can be reported as the counterparty. If a trading facility is fulfilling the reporting obligation, the identifier of Counterparty 1 identifies one of the counterparties to the transaction.	Char(20) for an LEI code	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction- M Collateral -M Valuation -M
2	CDE	Counterparty 2 (non-reporting counterparty)	Identifier of the non-reporting counterparty.	Identifier of the second counterparty⁵ to an OTC derivative transaction. In the case of an allocated derivative transaction executed by a fund manager on behalf of a fund, the fund and not the fund manager is reported as the counterparty. However, if the allocation to specific funds does not take place prior to the reporting deadline, then the fund manager executing the transaction on behalf of the fund can be reported as the counterparty.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- M Collateral -M Valuation -M

⁴ References to “OTC derivative” and “transaction” in CDE data element explanations and in the Appendices to the Technical Manual should be read to mean derivative.

⁵ Only one counterparty should be reported. In cases where multiple counterparties are legally responsible as the second counterparty (for example joint and several liability, or solidary liability in Quebec), report only one of the counterparties and use the same counterparty for all continuation data and lifecycle events.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
3	CDE	Counterparty 2 identifier source	Type of Counterparty 2 identifier.	Source used to identify the Counterparty 2.	Char(4)	• LEID = Legal Entity Identifier • NPID = Natural Person Identifier, to identify persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity). • PLID = An internal identifier only if (1) Counterparty 2 is subject to a blocking law or consent requirement, (2) the applicable CSA regulatory authority has issued a relief decision to the reporting counterparty relating to blocking laws and consent requirements, and (3) the reporting counterparty is complying with the conditions of the relief decision.	N	Transaction- M Collateral - M Valuation - M
4	CDE	Buyer identifier	Identifier of the counterparty that is the buyer.	Identifier of the counterparty that is the buyer, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank}. When populated: - the value shall match the value in either [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2] - the value shall not match the value in [Seller identifier]. Collateral- NR Valuation- NR
5	CDE	Seller identifier	Identifier of the counterparty that is the seller.	Identifier of the counterparty that is the seller, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank}. When populated: - the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2] - the value shall not match the value in [Buyer identifier]. Collateral- NR Valuation- NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
6	CDE	Payer identifier [Payer identifier–Leg 1] [Payer identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the payer leg.	Identifier of the counterparty of the payer leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such reporting requirements.	N	Transaction- C if [Buyer identifier] and [Seller identifier] are not populated, else {blank}. When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2]. Collateral- NR Valuation- NR
7	CDE	Receiver identifier [Receiver identifier-Leg 1] [Receiver identifier-Leg 2]	Identifier of the counterparty of the receiver leg.	Identifier of the counterparty of the receiver leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such reporting requirements.	N	Transaction- C if [Buyer identifier] and [Seller identifier] are not populated, else {blank}. When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2]. Collateral- NR Valuation- NR
8	ESMA	Broker identifier ⁶	Identifier of a broker that acts as an intermediary for Counterparty 1 without becoming a counterparty.	In the case a broker acts as intermediary for the counterparty 1 without becoming a counterparty itself, the counterparty 1 shall identify this broker by legal entity identifier.	Char(20)	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/)	N	Transaction- O Collateral - NR Valuation - NR
9	CSA	Country and Province or Territory of Individual (non-reporting counterparty)	If an individual is a non-reporting counterparty, the individual's country of residence and, if the individual's residence is in Canada, the province or territory.	If the non-reporting counterparty is an individual, the individual's country of residence and, if the individual's residence is in Canada, the province or territory.	Varchar(5)	Any valid value based on ISO 3166-2 if the individual's residence is in Canada; otherwise, use ISO 3166 for the individual's country of residence.	N	Transaction- C if [Counterparty 2 identifier source] = 'NPID', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

⁶ The ESMA Data Element Name is "Broker ID".

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
10	CSA	Jurisdiction of Counterparty 1	Each jurisdiction in which Counterparty 1 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, if the non-reporting counterparty is an individual who is a resident of the jurisdiction, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).	Each jurisdiction in which Counterparty 1 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, if the non-reporting counterparty is an individual who is a resident of the jurisdiction, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).⁷	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	N	Transaction – M Collateral – M Valuation – M
11	CSA	Jurisdiction of Counterparty 2	Each jurisdiction in which Counterparty 2 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507</i>	Each jurisdiction in which Counterparty 2 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	N	Transaction – M Collateral – M Valuation – M

⁷ A list of qualified persons is available here: <https://lautorite.qc.ca/en/professionals/securities-and-derivatives/regulation-of-derivatives-markets-in-quebec>

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
			respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting (Québec) and is a qualified person under section 82 of the Derivatives Act (Québec).					

Data Elements Related to Derivatives

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
12	CDE	Effective date ⁸	Unadjusted date at which obligations under the derivative come into effect, as provided in the confirmation.	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction come into effect, as included in the confirmation. A non-exhaustive list of examples is: For credit default swaps on a credit index, effective date should be the effective date of the contract (which is usually one or two days following the execution date), not the roll date of the underlying index. For FRAs, effective date should be the effective date of the contract, not the settlement date. For options & swaptions, effective date should be the effective date of the contract, not the underlier. For IRS forward starting swaps, effective date should be the effective date of the contract, which is called the forward start date in the contract. For contracts without an effective date included in the confirmation, if reported, effective date which starts immediately should be the date part of Execution timestamp. For new contracts stemming from lifecycle events, effective date should be the effective date of the new contract.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- M Collateral- NR Valuation- NR

⁸ For commodities swaps, report the pricing start date.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
13	CDE	Expiration date ⁹	Unadjusted date at which obligations under the derivative cease to be effective, as provided in the confirmation.	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction stop being effective, as included in the confirmation. Early termination does not affect this data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- C if UPI.[ReturnorPayoutTrigger] is not 'Contract for Difference (CFD)' else {optional}. When populated, the value shall be equal to or later than the value in [Effective date] or the date portion of [Execution Timestamp] Collateral- NR Valuation- NR
14	CDE	Execution timestamp	Date and time of execution of a transaction.	Date and time a transaction was originally executed, resulting in the generation of a new UTI. This data element remains unchanged throughout the life of the UTI. ¹⁰	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC. ¹¹ If the time element is not required in a particular jurisdiction, time may be dropped given that – in the case of representations with reduced accuracy – ISO 8601 allows the complete representation to be omitted, the omission starting from the extreme right-hand side (in the order from the least to the most significant).	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- M Collateral- NR Valuation- NR
15	CDE	Reporting timestamp ¹²	Date and time of submission of the report to the trade repository.	Date and time of the submission of the report as reported to the trade repository.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction- M, the value shall be equal to or later than the value in [Execution timestamp] Collateral- M Valuation- M
16	CDE	Unique transaction identifier (UTI)	Unique identifier that identifies a derivative or position throughout its lifecycle.	A unique identifier assigned at the transaction or position level which identifies them uniquely throughout their lifecycle and used for all recordkeeping and reporting.	Varchar(52)	ISO 23897 Unique transaction identifier, up to 52 alphanumeric characters. New UTIs should be constructed solely from the upper-case alphabetic characters A–Z or the digits 0–9, inclusive in both cases. UTI is comprised of the LEI of the generating entity and a unique alphanumeric code.	N	Transaction- M Collateral- C if [Initial margin collateral portfolio code] = 'TRANSACTION-LEVEL', else {blank} Valuation- M

⁹ For commodities swaps, report the pricing end date.

¹⁰ For cleared derivatives, the execution timestamp is the date and time when the clearing agency accepts the original derivative for clearing.

¹¹ Both the date and time portion are required to be reported.

¹² Reporting timestamp (#15) is recorded and reported by the submitter.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
17	CDE	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	UTI assigned to a derivative before the occurrence of a lifecycle event that resulted in the current derivative.	UTI assigned to the predecessor transaction that has given rise to the reported transaction due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between transactions (e.g., in the case of a novation, when a transaction is terminated, and a new transaction is generated) or in a one-to-many relation between transactions (e.g., in clearing or if a transaction is split into several different transactions). This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between transactions (e.g., in the case of a compression).	Varchar(52)	ISO 23897 Unique transaction identifier, up to 52 alphanumeric characters. New UTIs should be constructed solely from the upper-case alphabetic characters A–Z or the digits 0–9, inclusive in both cases.	N	Transaction- C if [Action type] = 'NEWT' and ([Event type] = 'NOVA' or 'CLRG' or 'EXER' or 'ALOC' or 'CLAL') and [Prior USI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)] is not populated, else {optional} Collateral- NR Valuation- NR
18	ESMA	Subsequent position UTI	UTI of the position in which a derivative is included.	The UTI of the position in which a derivative is included. This field is applicable only for the reports related to the termination of a derivative due to its inclusion in a position.	Up to 52 alphanumeric characters, only the upper-case alphabetic characters A–Z and the digits 0–9 are allowed	Upper-case alphabetic characters A–Z and digits 0–9 allowed	N	Transaction – C if ([Action type] = 'POSC') or ([Action type] = 'TERM' and [Event type] = 'INCP'), else {blank} Collateral – NR Valuation - NR
19	CFTC	Prior USI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Unique swap identifier (USI) assigned to a derivative before the occurrence of a lifecycle event that resulted in the current derivative.	Unique swap identifier (USI) assigned to the predecessor transaction that has given rise to the reported transaction due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between transactions (e.g., in the case of a novation, when a transaction is terminated, and a new transaction is generated) or in a one-to-many relation between transactions (e.g., in clearing or if a transaction is split into several different transactions). This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between transactions (e.g., in the case of a compression).	Varchar(42)	Refer to: CFTC USI Data Standard Up to 42 alphanumeric characters	N	Transaction- C if [Action type] = 'NEWT' and ([Event type] = 'NOVA' or 'CLRG' or 'EXER' or 'ALOC' or 'CLAL') and [Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)] is not populated, else {optional} Collateral- NR Valuation- NR
20	CSA	Inter-affiliate indicator	Indicator of whether the derivative is between two affiliated entities.	Indicate whether the derivative is between two affiliated entities.	Boolean	•True = contract entered into as an inter-affiliate transaction •False = contract not entered into as an inter-affiliate transaction	N	Transaction – C if [Platform anonymous execution indicator] = 'False' and [Cleared] = 'N', else {optional} Collateral – NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
21	CDE	Submitter identifier	Identifier of the entity submitting derivatives data to the trade repository.	Identifier of the entity submitting the OTC derivative transaction to the Trade Repository. If a third-party service provider is used to submit the data to the Trade Repository, report the identifier of the third-party service provider.	Char(20)	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction- M Collateral- M Valuation- M
22	CDE	Platform identifier	Identifier of the trading facility on which the transaction was executed.	Identifier of the trading facility (e.g., exchange, multilateral trading facility, swap execution facility) on which the transaction was executed.	Char(4)	ISO 10383 Segment Market Identifier Code. ¹³ If no trading facility was involved in the transaction: • XOFF, for transactions in listed instruments • XXXX, for transactions in instruments that are not listed in any venue • BILT, if the reporting counterparty cannot determine whether the instrument is listed or not, as per jurisdictional requirements.	Y	Transaction- C if [Cleared] = 'N' or 'I', else {optional} Collateral- NR Valuation- NR
23	CSA	Platform anonymous execution indicator	Indicator of whether the transaction was executed anonymously on a trading facility.	Indicator of whether the transaction was executed anonymously on a trading facility.	Boolean	• True = transaction was executed anonymously on a platform • False = transaction was not executed anonymously on a platform or not applicable	N	Transaction – M ¹⁴ Collateral – NR Valuation - NR
24	ESMA	Master agreement type	Type of master agreement.	Reference to the master agreement type under which the counterparties concluded a derivative.	Char(4)	• 'ISDA' - ISDA • 'CDEA' - FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement • 'EUMA' - European Master Agreement • 'FPCA' - FOA Professional Client Agreement • 'FMAT' - FBF Master Agreement relating to transactions on forward financial instruments • 'DERV' - Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) • 'CMOP' - Contrato Marco de Operaciones Financieras • 'CHMA' - Swiss Master Agreement • 'IDMA' - Islamic Derivative Master Agreement • 'EFMA' - EFET Master Agreement • 'GMRA' - GMRA • 'GMSL' - GMSLA • 'BIAG' - bilateral agreement • Or 'OTHR' for cleared swaps and for any other derivative transaction that is not covered by a Master Agreement type, or where the relevant Master Agreement is not included in the preceding list.	N	Transaction – C if [Platform anonymous execution indicator] = 'False', else {optional} Collateral – NR Valuation - NR

¹³ Where the Segment MIC does not exist, use the Operating MIC.

¹⁴ Data element 23 is mandatory for transactions executed on a trading facility.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description <i>(from Appendix A to the TR Rules)</i>	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
26	CDE	Notional amount ¹⁵ [Notional amount-Leg 1] [Notional amount-Leg 2]	Notional amount for each leg of a derivative: • if the derivative is negotiated in a monetary amount, the amount specified in the derivative. • if the derivative is negotiated in a non-monetary amount, convert to a monetary amount.	For each leg of the transaction, where applicable: - for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts, the amount specified in the contract. - for OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts, refer to Appendix 3.1 for converting notional amounts for non-monetary amounts. • For OTC derivative transactions with a notional amount schedule, the initial notional amount, agreed by the counterparties at the inception of the transaction, is reported in this data element. • For OTC foreign exchange options, in addition to this data element, the amounts are reported using the data elements Call amount and Put amount. • For amendments or lifecycle events¹⁶, the resulting outstanding notional amount is reported; (steps in notional amount schedules are not considered to be amendments or lifecycle events); • Where the notional amount is not known when a new transaction is reported, the notional amount is updated as it becomes available.	Num(25,5)	Any value (Negative values are only allowed for commodity derivatives when applies, e.g. to account for the cost of storage.) ¹⁷	Y	Transaction- M Collateral- NR Valuation- NR
27	CDE	Notional currency [Notional currency-Leg 1] [Notional currency-Leg 2]	For each leg of a derivative, the currency of the notional amount.	For each leg of the transaction, where applicable: currency in which the notional amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	Y	Transaction – [Notional currency – Leg 1] C if [Notional amount – Leg 1] is populated, else {blank} [Notional currency – Leg 2] C if [Notional amount – Leg 2] is populated, else {blank} Collateral - NR

¹⁷ "gggggggggggggggggggggg.99999" is accepted when the value is not available. 25 numerical characters including decimals.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Valuation - NR
28	CDE	Call amount	Monetary amount that a person or company has the right to buy under an option.	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to buy.	Num(25,5)	Any value greater than zero.	N	Transaction – FX C if UPL.[Instrument type] = 'Option' and UPL.[Product] ≠ 'Digital Option', at least one is required: ([Call amount] or [Put amount]), else {optional} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation NR
29	CDE	Call currency	Currency of the call amount of an option.	For foreign exchange options, the currency in which the Call amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction – FX C if [Call amount] is populated, else {blank} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR
30	CDE	Put amount	Monetary amount that a person or company has the right to sell under an option.	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to sell.	Num(25,5)	Any value greater than zero.	N	Transaction - FX C if UPL.[Instrument type] = 'Option' and UPL.[Product] ≠ 'Digital Option', at least one is required: ([Call amount] or [Put amount]), else {optional} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR
31	CDE	Put currency	Currency of the put amount of an option.	For foreign exchange options, the currency in which the Put amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction – FX C if [Put amount] is populated, else {blank} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
32	CFTC	Notional quantity [Notional quantity-Leg 1] [Notional quantity-Leg 2]	For each leg of a derivative negotiated in a non-monetary amount, the fixed notional quantity for each schedule period.	For each leg of the swap transaction ¹⁸ where applicable, for swap transactions negotiated in non-monetary amounts, the fixed notional quantity for each schedule period (i.e., 50 barrels per month). The frequency is reported in Quantity frequency and the unit of measure is reported in Quantity unit of measure.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction – CO O When populated, the value shall be equal to or less than the value in [Total notional quantity]. Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Collateral - NR Valuation - NR
33	CFTC	Quantity frequency ¹⁹ [Quantity frequency-Leg 1] [Quantity frequency-Leg 2]	Period for which the quantity is quoted.	For each leg of the swap transaction where applicable, the rate at which the quantity is quoted on the transaction. e.g., hourly, daily, weekly, monthly.	Char(4)	• HOUL = Hourly • DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • ONDE = OnDemand • YEAR = Yearly • EXPI = End of term • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular	N	Transaction - CO [Quantity frequency – Leg 1] C if [Notional quantity – Leg 1] is populated, else {blank} [Quantity frequency – Leg 2] C if [Notional quantity – Leg 2] is populated, else {blank} Transaction – IR/FX/CR/EQ - NR Collateral - NR Valuation - NR
34	CFTC	Quantity frequency multiplier [Quantity frequency multiplier-Leg 1] [Quantity frequency multiplier-Leg 2]	Number of periods of the quantity frequency.	For each leg of the swap transaction where applicable, the number of time units for the Quantity frequency.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - CO [Quantity frequency multiplier – Leg 1] C if [Quantity frequency – Leg 1] ≠ 'ONDE' or 'ADHO', else {optional} [Quantity frequency multiplier – Leg 2] C if [Quantity frequency – Leg 2] ≠ 'ONDE' or 'ADHO', else {optional} Transaction – IR/FX/CR/EQ - NR Collateral - NR Valuation - NR

¹⁸ References to “swap” and “swap transaction” in CFTC data element explanations should be read as derivative.

¹⁹ To represent quarterly, report [Quantity frequency] = 'MNTH' and [Quantity frequency multiplier] = '3'. For semi-annual, report [Quantity frequency] = 'MNTH' and [Quantity frequency multiplier] = '6'.

23

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				The quantity unit of measure for the varying notional quantities in the schedule is reported in Quantity unit of measure.				
39	CDE	Notional quantity schedule - Notional quantity in effect on associated effective date [Notional quantity in effect on associated effective date-Leg 1] [Notional quantity in effect on associated effective date-Leg 2]	Each notional quantity, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 37 to the date referred to in Data Element Number 38.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts with a Notional quantity schedule: Notional quantity which becomes effective on the associated unadjusted effective date. The initial notional quantity schedule – notional quantity is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional quantities that are condition- or event-dependent. The quantity unit of measure for the varying notional quantities in the schedule is reported in Quantity unit of measure.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction – CO O The number of notional quantity values must equal the number of date intervals. Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Collateral - NR Valuation - NR
40	CDE	Notional amount schedule - notional amount in effect on associated effective date [Notional amount in effect on associated effective date-Leg 1] [Notional amount in effect on associated effective date-Leg 2]	Each notional amount, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 41 to the date referred to in Data Element Number 42.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: Notional amount which becomes effective on the associated unadjusted effective date. The initial notional amount schedule – notional amount is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.	Num(25,5)	Any value.	N	Transaction - IR C if UPI.[Notional schedule] ≠ 'Constant', else {optional} The number of notional amount values must equal the number of start and end date intervals. Transaction – CR/FX/CO/EQ - O Collateral - NR Valuation - NR
41	CDE	Notional amount schedule - unadjusted effective date of the notional amount [Effective date of the notional amount-Leg 1] [Effective date of the notional amount-Leg 2]	For each notional amount set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the notional amount becomes effective.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: Unadjusted date on which the associated notional amount becomes effective The initial notional amount schedule – effective date is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Notional amount schedule - notional amount in effect on associated effective date] is populated, else {blank} The number of date values must equal the number of notional amount values. Collateral - NR Valuation - NR
42	CDE	Notional amount schedule - unadjusted end date of the notional amount	For each notional amount set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the notional amount.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: Unadjusted end date of the notional amount (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction – O The number of date values must equal the number of notional amount values if populated.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
		[End date of the notional amount-Leg 1] [End date of the notional amount-Leg 2]		with the unadjusted effective date of the subsequent period). The initial notional amount schedule - end date is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.				Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Prices

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
43	CDE	Exchange rate ²¹	Exchange rate between 2 different currencies specified in the derivative.	Exchange rate between the two different currencies specified in the OTC derivative transaction agreed by the counterparties at the inception of the transaction, expressed as the rate of exchange from converting the unit currency into the quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency; USD 1 = EUR 0.9426. Forward exchange rate should be reported.	Num(18,13)	Any value greater than zero.	N	Transaction – FX – C if [UPI].[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction – IR/CR/CO/EQ - NR Collateral – NR Valuation – NR
44	CDE	Exchange rate basis	Currency pair and order in which the exchange rate is denominated.	Currency pair and order in which the exchange rate is denominated, expressed as unit currency/quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency, USD 1 = EUR 0.9426.	Char(3)/Char(3); [Unit currency/Quoted currency], without restricting the currency pair ordering (i.e., the exchange rate basis may be USD/EUR or EUR/USD.	Any pair of currencies included in ISO 4217.	N	Transaction – FX M Transaction – IR/CR/CO/EQ - NR Collateral – NR Valuation – NR
45	CDE	Fixed rate [Fixed rate-Leg 1] [Fixed rate-Leg 2]	For each leg of a derivative with periodic payments, the annual rate of the fixed leg.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments, per annum rate of the fixed leg(s).	Num(11,10)	Positive and negative values expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%)	Y	Transaction – CR C if [Spread] is not populated and [Other payment type] ≠ 'UFRO', and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction - IR C if [Spread] is not populated [and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional}]

²¹ For FX, forward exchange rate would be reported in this data element.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Transaction - CO C if [Price] or [Spread] is not populated and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction – FX/EQ - O Collateral - NR Valuation - NR
46	CDE	Price ²²	Price specified in the derivative.	Price specified in the OTC derivative transaction. It does not include fees, taxes or commissions. For commodity fixed/float swaps and similar products²³ with periodic payments, this data element refers to the fixed price of the fixed leg(s). For commodity and equity forwards and similar products, this data element refers to the forward price of the underlying or reference asset. For equity swaps, portfolios swaps, and similar products, this data element refers to the initial price of the underlying or reference asset. For contracts for difference and similar products, this data element refers to the initial price of the underlier. This data element is not applicable to: - Interest rate swaps and forward rate agreements, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate and Spread may be interpreted as the price of the transaction. - Interest rate options and interest rate swaptions as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Commodity basis swaps as it is understood that the information included in the data element Spread may be interpreted as the price of the transaction. - Foreign exchange swaps, forwards and options, as it is understood that the information included in the data elements Exchange rate, Strike price, and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Equity options as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Credit default swaps and credit total return swaps, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate, Spread and Upfront payment (Other payment type: Upfront payment) may be interpreted as the price of the transaction.	- Num(18,13), if Price notation = 1 - Num(11,10), if Price notation = 3	- Any value, if Price notation = 1 - Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Price notation = 3	Y	Transaction - EQ C if [Spread] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction - CO C if ([Fixed rate] or [Spread] is not populated), and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction – IR/FX/CR - O Collateral – NR Valuation - NR

²² While Price (#46) captures the prices at which counterparties negotiate contracts, market prices are reflected in the valuation amounts.

²³ References to “product” in CDE data element explanations should be read to mean derivative.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				Commodity options, as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. Where the price is not known when a new transaction is reported, the price is updated as it becomes available. For transactions that are part of a package, this data element contains the price of the component transaction where applicable.				
47	CDE	Price currency	Currency in which the price is denominated.	Currency in which the price is denominated. Price currency is only applicable if Price notation = 1.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction - C if [Price notation] = '1', else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
48	CDE	Price notation	Manner in which the price is expressed.	Manner in which the price is expressed.	Char(1)	1 = Monetary amount 3 = Decimal	Y	Transaction - C if [Price] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
49	CDE	Price unit of measure	Unit of measure in which the price is expressed.	Unit of measure in which the price is expressed.	Varchar(4)	ISO 20022: UnitOfMeasureCode codeset or other TR approved UOM codeset	N	Transaction - C if [Price] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
50	CDE	Price schedule - unadjusted effective date of the price	For each price set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the price becomes effective.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: Unadjusted effective date of the price. Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	YYYY-MM-DD, based on UTC	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - C if [Price schedule - price] is populated, else {blank} The number of date values must equal the number of price values. Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
51	CDE	Price schedule - unadjusted end date of the price	For each price set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the price.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: Unadjusted end date of the price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period). Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - O The number of date values must equal the number of price values if populated. Collateral - NR Valuation - NR
52	CDE	Price schedule - price	Each price, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 50 to the date referred to in Data Element Number 51.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: Price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	- Num(18,13), if Price notation = 1 - Num(11,10), if Price notation = 3	- Any value greater than zero, if Price notation = 1 - Any value expressed as decimal (eg 0.0257 instead of 2.57%), if Price notation = 3	N	Transaction - EQ C if [Price] or [Spread] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction - CO C if ([Price], [Fixed rate], or [Spread] is not populated) and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} The number of price values must equal the number of start date intervals. Transaction - CR/IR/FX - O Collateral - NR Valuation - NR
53	CDE	Spread ²⁴ [Spread-Leg 1] [Spread-Leg 2]	For each leg of a derivative, the specified spread on the reference price.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments (e.g., interest rate fixed/float swaps, interest rate basis swaps, commodity swaps), - spread on the individual floating leg(s) index reference price, in the case where there is a spread on a floating leg(s). For example, USD-LIBOR-BBA plus .03 or WTI minus USD 14.65; or - difference between the reference prices of the two floating leg indexes. For example, the 9.00 USD "Spread" for a WCS vs. WTI basis swap where WCS is priced at 43 USD and WTI is priced at 52 USD.	- Num(18,13), if Spread notation = 1 - Num(11,10), if Spread notation = 3 - Num(5), if Spread notation = 4	- Any value, if Spread notation = 1 - Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Spread notation = 3 - Any integer value expressed in basis points (e.g., 257 instead of 2.57%), if Spread notation = 4	Y	Transaction - CR C if [Fixed rate] is not populated and [Other payment type] ≠ 'Upfront payment UFRO', and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction - IR C if [Fixed rate] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction - EQ C if [Price] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional}

²⁴ For equity swaps, portfolio swaps, and contract for difference (CFDs), report the weighted overall spread for the basket instead of individual legs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Transaction – CO C if [Price] or [Fixed rate] is not populated, and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction – FX - NR Collateral – NR Valuation – NR
54	CDE	Spread currency [Spread currency-Leg 1] [Spread currency-Leg 2]	For each leg of a derivative, the currency in which a spread is denominated.	For each leg of the transaction, where applicable: the currency in which the spread is denominated. This data element is only applicable if Spread notation = 1.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction – [Spread currency – Leg 1] C if [Spread notation – Leg 1] = '1', else {blank} [Spread currency – Leg 2] C if [Spread notation – Leg 2] = '1', else {blank} Collateral – NR Valuation - NR
55	CDE	Spread notation [Spread notation - Leg 1] [Spread notation - Leg 2]	For each leg of a derivative, the manner in which a spread is expressed.	For each leg of the transaction, where applicable: the manner in which the spread is expressed.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal • 4 = Basis points	Y	Transaction – [Spread notation – Leg 1] C if [Spread – Leg 1] is populated, else {blank} [Spread notation – Leg 2] C if [Spread – Leg 2] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
56	CDE	Strike price	For a derivative that is an option, the price at which the owner of the option can buy or sell the underlying interest of the option.	• For options other than FX²⁵ options, swaptions and similar products, the price at which the owner of an option can buy or sell the underlying asset of the option. • For FX options, the exchange rate at which the option can be exercised, expressed as the rate of exchange from converting the unit currency into the quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency; USD 1 = EUR 0.9426. Where the strike price is not known when a new transaction is reported, the strike price is updated as it becomes available. • For volatility and variance swaps and similar products, the volatility / variance strike price.	• Num(18,13), if Strike price notation = 1 • Num(11,10), if Strike price notation = 3	• Any value (e.g., USD 6.39 expressed as 6.39), for equity options, commodity options, foreign exchange options and similar products, if Strike price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.021 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 3	Y	Transaction - C if UPI.[Instrument type] = 'Option', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

²⁵ References to "FX" in CDE data element explanations should be read to mean foreign exchange.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
57	CDE	Strike price currency/currency pair	Currency, or the currency pair and order, in which the strike price is denominated.	For equity options, commodity options, and similar products, the currency in which the strike price is denominated. For foreign exchange options: the currency pair and order in which the strike price is expressed. The strike price is expressed as unit currency/quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency, USD 1 = EUR 0.9426 Strike price currency/currency pair is only applicable if Strike price notation = 1.	• Char(3) • For foreign exchange options: Char(3)/Char(3); [Unit currency/Quoted currency] without restricting the currency pair ordering (i.e., the Strike price currency pair may be USD/EUR or EUR/USD).	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - C if [Strike price notation] = '1', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
58	CDE	Strike price notation	Manner in which the strike price is expressed.	Manner in which the strike price is expressed.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal	Y	Transaction - C if [Strike price] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
59	CDE	Unadjusted effective date of the price	Effective date (unadjusted for business day convention) of the price.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]
60	CDE	Unadjusted end date of the price	End date (unadjusted for business day convention) of the price.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]
61	CDE	Price in effect between the unadjusted effective and end dates	Price in effect from the date referred to in Data Element Number 59 to the date referred to in Data Element Number 60.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
62	CDE	Effective date of the strike price	Effective date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]
63	CDE	End date of the strike price	End date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]
64	CDE	Strike price in effect on associated effective date	Strike price in effect from the date referred to in Data Element Number 62 to the date referred to in Data Element Number 63.	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	N	[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]
65	CDE	Strike price schedule – Unadjusted effective date of the strike price	For each strike price set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the strike price becomes effective.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted effective date of the strike price. Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Strike price schedule - strike price] is populated, else {blank} The number of date values must equal the number of strike price values. Collateral - NR Valuation - NR
66	CDE	Strike price schedule – Unadjusted end date of the strike price	For each strike price set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted end date of the strike price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period). Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - O The number of date values must equal the number of strike price values if populated. Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
67	CDE	Strike price schedule - strike price	Each strike price, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 65 to the date referred to in Data Element Number 66.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: Strike price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	- Num(18,13), if Strike price notation = 1 - Num(11,10), if Strike price notation = 3	- Any value (e.g. USD 6.39 expressed as 6.39), for equity options, commodity options, foreign exchange options and similar products, if Strike price notation = 1 - Any value expressed as decimal (e.g. 0.021 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 3	N	Transaction C if [Strike price] is not populated, and UPL[Instrument type] = 'Option', else {optional} The number of strike price values must equal the number of start date intervals. Collateral - NR Valuation - NR
68	CFTC	Non-standardized term indicator	Indicator of whether a derivative has one or more additional provisions that materially affect the price of the derivative and that have not been disclosed to the public.	Indicator of whether the swap transaction has one or more additional term(s) or provision(s), other than those disseminated to the public pursuant to part 43, ²⁶ that materially affect(s) the price of the transaction.	Boolean	- True - False	Y	Transaction - C if [Cleared] = 'N', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
69	CDE	Day count convention [Fixed rate day count convention-Leg 1] [Fixed rate day count convention-Leg 2] [Floating rate day count convention-Leg 1] [Floating rate-day count convention-Leg 2]	For each leg of a derivative, the day count convention used to determine how interest payments are calculated.	For each leg of the transaction, where applicable: day count convention (often also referred to as day count fraction or day count basis or day count method) that determines how interest payments are calculated. It is used to compute the year fraction of the calculation period, and indicates the number of days in the calculation period divided by the number of days in the year. See Appendix 3.2 for definitions of values.	Char(4)	- A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule - A002 = IC30365 - A003 = IC30Actual - A004 = Actual360 - A005 = Actual365Fixed - A006 = ActualActualCMA - A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 - A008 = ActualActualISDA - A009 = Actual365LorActuActubasisRule - A010 = ActualActualAFB - A011 = IC30360ICMAor30360basicrule - A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 - A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 - A014 = Actual365NL - A015 = ActualActualUltimo - A016 = IC30EPlus360 - A017 = Actual364 - A018 = Business252 - A019 = Actual360NL - A020 = 1/1 - NARR = Narrative	Y	Transaction – [Floating rate day count convention – Leg 1] C if [Fixed rate payment frequency period – Leg 1] is populated, else {blank} [Floating rate day count convention – Leg 2] C if [Fixed rate payment frequency period – Leg 2] is populated, else {blank} [Floating rate day count convention – Leg 1] CO/EQ C if [Floating rate payment frequency period – Leg 1] is populated, else {optional} CR/IR/FX O [Floating rate day count convention – Leg 2] CO/EQ C if [Floating rate payment frequency period – Leg 2] is populated, else {optional} CR/IR/FX O Collateral - NR

²⁶ The reporting counterparty may report this data element in a manner that reflects public dissemination under the requirements of any regulator (for example, under CFTC Part 43 or the TR Rules).

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Valuation - NR
70	CFTC	Floating rate reset frequency period [Floating rate reset frequency period-Leg 1] [Floating rate reset frequency period-Leg 2]	For each floating leg of a derivative, the period of the frequency of resets.	For each floating leg of the swap transaction where applicable, time unit associated with the frequency of resets, e.g., day, week, month, year or term of the stream.	Char(4)	• DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • YEAR = Yearly • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular • EXPI = Payment at term	Y	Transaction – [Floating rate reset frequency period – Leg 1] IR C if UPI.[Instrument type] = 'Swap' and UPI.[Underlying Asset Type] ≠ 'Fixed - Fixed', and [Floating rate reset frequency period – Leg 2] is null, else {optional} [Floating rate reset frequency period – Leg 2] IR C if UPI.[Instrument type] = 'Swap' and UPI.[Underlying Asset Type] ≠ 'Fixed - Fixed', and [Floating rate reset frequency period – Leg 1] is null, else {optional} Transaction – CR/FX/EQ/ICO - 0 Collateral - NR Valuation - NR
71	CFTC	Floating rate reset frequency period multiplier [Floating rate reset frequency period multiplier-Leg 1] [Floating rate reset frequency period multiplier-Leg 2]	For each floating leg of a derivative, the number by which the floating rate reset frequency period is multiplied to determine the frequency of periodic payment dates in respect of a reset.	For each floating leg of the swap transaction, where applicable, number of time units (as expressed by the Floating rate reset frequency period) that determines the frequency at which periodic payment dates for reset occur. For example, a transaction with reset payments occurring every two months is represented with a Floating rate reset frequency period of "MNTH" (monthly) and a Floating rate reset frequency period multiplier of 2. This data element is not applicable if the Floating rate reset frequency period is "ADHO". If Floating rate reset frequency period is "EXPI", then the Floating rate reset frequency period multiplier is 1. If the reset frequency period is intraday, then the Floating rate reset frequency period is "DAIL" and the Floating rate reset frequency period multiplier is 0.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction - [Floating rate reset frequency period multiplier – Leg 1] C if [Floating rate reset frequency period – Leg 1] is populated and ≠ 'ADHO', else {blank}. [Floating rate reset frequency period multiplier – Leg 2] C if [Floating rate reset frequency period – Leg 2] is populated and ≠ 'ADHO', else {blank}.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								When [Floating rate reset frequency period – Leg 1] is populated with 'EXPI', [Floating rate reset frequency period multiplier – Leg 1] must be '1' When [Floating rate reset frequency period – Leg 2] is populated with 'EXPI', [Floating rate reset frequency period multiplier – Leg 2] must be '1' Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Clearing

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
72	CDE	Cleared	Indicator of whether a derivative has been cleared, or is intended to be cleared, by a clearing agency.	Indicator of whether the transaction has been cleared, or is intended to be cleared, by a central counterparty. ²⁷	Char(1)	• Y = Yes, centrally cleared, for beta and gamma transactions. • N = No, not centrally cleared. • I = Intent to clear, for alpha transactions that are planned to be submitted to clearing.	Y	Transaction- M Collateral - NR Valuation - NR
73	CDE	Central counterparty identifier	Identifier of the clearing agency that cleared the derivative.	Identifier of the central counterparty (CCP) that cleared the transaction. This data element is not applicable if the value of the data element "Cleared" is "N" ("No, not centrally cleared") or "I" ("Intent to clear").	Char(20)	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org).	N	Transaction - C if [Cleared] = "Y", else {optional} When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)]. Collateral - NR Valuation - NR

²⁷ References to "central counterparty" in CDE data element explanations should be read to mean clearing agency or, in Quebec, clearing house.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
74	CFTC	Clearing account origin	Indicator of whether the clearing member acts as principal or agent.	Indicator of whether the clearing member acted as principal for a house trade or an agent for a customer trade.	Char(4)	• HOUS = House • CLIE = Client	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
75	CDE	Clearing member identifier	Identifier of the clearing member through which a derivative is cleared by a clearing agency.	Identifier of the clearing member through which a derivative transaction was cleared at a central counterparty. This data element is applicable to cleared transactions under both the agency clearing model and the principal clearing model. ²⁸ • In the case of the principal clearing model, the clearing member is identified as clearing member and also as a counterparty in both transactions resulting from clearing: (i) in the transaction between the central counterparty and the clearing member; and (ii) in the transaction between the clearing member and the counterparty to the original alpha transaction. • In the case of the agency clearing model, the clearing member is identified as clearing member but not as the counterparty to transactions resulting from clearing. Under this model, the counterparties are the central counterparty and the client. This data element is not applicable if the value of the data element "Cleared" is "N" ("No, not centrally cleared") or "I" ("Intent to clear").	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
76	CFTC	Clearing receipt timestamp	Date and time, expressed using Coordinated Universal Time, that the original derivative was recorded as being received by the clearing agency for clearing.	The date and time, expressed in Coordinated Universal Time (UTC), the original swap was received by the derivatives clearing organization (DCO) for clearing and recorded by the DCO's system. ²⁹	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y' or ([Cleared] = 'I' and [Action type] = 'TERM' and [Event type] = 'CLRG') or ([Cleared] = 'I' and [Action type] = 'TERM' and [Event type] = 'CLAL'), else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

²⁸ Reporting counterparties should report "clearing swaps" according to the agency clearing model.

²⁹ References to "derivatives clearing organization" or "DCO" in CFTC data element explanations should be read to mean clearing agency or, in Quebec, clearing house.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
77	CFTC	Clearing exceptions and exemptions - Counterparty 1	Type of exemption from or exception to a mandatory clearing requirement applicable to Counterparty 1.	The type of clearing exception or exemption that Counterparty 1 has elected or otherwise falls under. ³⁰ All applicable exceptions and exemptions must be selected. The values may be repeated as applicable.	Char(4)	• AFFL = Inter-affiliate exemption, • OTHR = Other exceptions or exemptions <i>Additional values only relevant to CFTC:</i> • ENDU = End-user exception, • SMBK = Small bank exemption, • COOP = Cooperative exemption, • NOAL = No-action Letter	N	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR
78	CFTC	Clearing exceptions and exemptions – Counterparty 2	Type of exemption from or exception to a mandatory clearing requirement applicable to Counterparty 2.	Identifies the type of the clearing exception or exemption that Counterparty 2 has elected or otherwise falls under. All applicable exceptions and exemptions must be selected. The values may be repeated as applicable.	Char(4)	• AFFL = Inter-affiliate exemption, • OTHR = Other exceptions or exemptions <i>Additional values only relevant to CFTC:</i> • ENDU = End-user exception, • SMBK = Small bank exemption, • COOP = Cooperative exemption, • NOAL = No-action Letter	N	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Collateral and Margin

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
79	CDE	Collateralisation category	Indicator of whether there is an agreement in respect of collateral between the counterparties and the nature of the collateralisation.	Indicator of whether a collateral agreement (or collateral agreements) between the counterparties exists (uncollateralised/partially collateralised/one-way collateralised/fully collateralised). This data element is provided for each transaction or each portfolio, depending on whether the collateralisation is performed at the transaction or portfolio level, and is applicable to both cleared and uncleared transactions.	Char(4)	• UNCL • PRC1 • PRC2 • PRC1 • OWC1 • OWC2 • OWP1 • OWP2 • FLCL	N	Transaction - M Collateral – M Valuation - NR
80	CFTC	Portfolio containing non-reportable component indicator	If collateral is reported on a portfolio basis, indicator of whether the portfolio includes derivatives exempted or excepted from reporting.	If collateral is reported on a portfolio basis, indicator of whether the collateral portfolio includes swap transactions exempt from reporting.	Boolean	• True • False	N	Transaction – NR Collateral – M Valuation - NR

³⁰ Refer to Parts 3 and 5 of NI 94-101 *Mandatory Central Counterparty Clearing of Derivatives*. However, reporting counterparties may provide clearing exceptions for Data Elements # 77 and 78 that are relevant to CFTC. As a result, reporting counterparties should not need to report these data elements differently under the TR Rules compared to how they are reported for the CFTC.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
81	CDE	Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the initial margin posted by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the central counterparty, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C if ([Collateralisation category] = 'OWC1' or 'OWP1' or 'FLCL'), else {optional} ³¹ Valuation - NR
82	CDE	Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the initial margin posted by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the central counterparty, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C if ([Collateralisation category] = 'OWC1' or 'OWP1' or 'FLCL'), else {optional} ³² Valuation - NR

³¹ In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (eg. Because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

³² In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g., Because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
83	CDE	Currency of initial margin posted ³³	Currency in which the initial margin posted is denominated.	Currency in which the initial margin posted is denominated. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of posted initial margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)] or [Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR
84	CDE	Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the initial margin collected by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the central counterparty as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = 'OWC2' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {optional} ³⁴ Valuation - NR
85	CDE	Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the initial margin collected by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the central counterparty as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = OWC2 or 'OWP2' or 'FLCL'), else {optional} ³⁵ Valuation - NR

³³ For portfolio with multiple currencies, it must be converted in to a single currency chosen by the reporting counterparty and reported.

³⁴ In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

³⁵ In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.				
86	CDE	Currency of initial margin collected ³⁶	Currency in which the initial margin collected is denominated.	Currency in which the initial margin collected is denominated. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of collected initial margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)] or [Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR
87	CDE	Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut) ³⁷	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of variation margins posted for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = 'PRC1' or 'PRCL' or 'OWC1' or 'OWP1' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {optional} ³⁸ Valuation - NR

³⁶ For portfolio with multiple currencies, it must be converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported.

³⁷ This data element must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

³⁸ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
88	CDE	Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of posted variation margins for the portfolio /transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C if ([Collateralisation category] = 'PRC1' or 'PRCL' or 'OWC1' or 'OWP1' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {optional} ³⁹ Valuation - NR
89	CDE	Currency of variation margin posted	Currency in which the variation margin posted is denominated.	Currency in which the variation margin posted is denominated. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of posted variation margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral - C if [Variation margin posted by the reporting counterparty (pre- haircut)] or [Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR
90	CDE	Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut) ⁴⁰	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin,	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C if ([Collateralisation category] = 'PRC2' or 'PRCL' or 'OWC2' or 'OWP1' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {optional} ⁴¹ Valuation - NR

³⁹ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

⁴⁰ This data element must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

⁴¹ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio/ transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.				
91	CDE	Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin collected after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio /transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = PRC2' or PRCL' or 'OWC2 or OWP1' or OWP2' or FLCL'), else {optional} ⁴² Valuation - NR
92	CDE	Currency of variation margin collected	Currency in which the variation margin collected is denominated.	Currency in which the variation margin collected is denominated. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of collected variation margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Variation margin collected by the reporting counterparty (pre- haircut)] or [Variation margin collected by the reporting counterparty (post- haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR

⁴² In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
93	CDE	Variation margin collateral portfolio code	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty that identifies the variation margin related to the open transactions that are included in the portfolio.	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty to the portfolio that tracks the aggregate variation margin of a set of derivative transactions. This data element is not applicable if the collateralisation was performed on a transaction level basis, or if there is no collateral agreement or if no variation margin is posted or received.	Varchar(52)	Up to 52 alphanumeric characters ⁴³	N	Transaction – O Collateral – C if [Initial margin collateral portfolio code] is not populated, else {optional} Valuation – C if [Initial margin collateral portfolio code] is not populated, else {optional}
94	CDE	Initial margin collateral portfolio code	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty that identifies the initial margin related to the open transactions that are included in the portfolio.	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty to the portfolio that tracks the aggregate initial margin of a set of derivative transactions. This data element is not applicable if the collateralisation was performed on a transaction level basis, or if there is no collateral agreement or if no initial margin is posted or received.	Varchar(52)	Up to 52 alphanumeric characters ⁴⁴	N	Transaction – O Collateral – C if [Variation margin collateral portfolio code] is not populated, else {optional} Valuation – C if [Variation margin collateral portfolio code] is not populated, else {optional}

Data Elements Related to Actions and Events

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
95	CDE	Event timestamp	Date and time of occurrence of an event relating to a derivative.	Date and time of occurrence of the event for which a report is made. In the case of a modification agreed for a future date, this data element should reflect the date, the modification occurs (becomes effective) and not when it was negotiated. In the case of a correction, this data element should reflect the date and time as of when the correction is applicable. In the case of a clearing event, this data element should reflect the recorded date and time when the alpha transaction is accepted by the central counterparty (CCP) for clearing. In the case of collateral update, the date and time for which the information contained in the report is provided.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC. ⁴⁵	Any valid date/time based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction - M, The value shall be equal to or later than the value in [Execution timestamp] Collateral - M Valuation - NR

⁴³ If collateralization was performed on a transaction level basis, "TRANSACTIONLEVEL" is accepted. "NOTAPPLICABLE" is accepted if (i) collateralization was performed on a portfolio basis and there is no VM portfolio code, or (ii) it is a submission from a DCO.

⁴⁴ If collateralization was performed on a transaction level basis, "TRANSACTIONLEVEL" is accepted. "NOTAPPLICABLE" is accepted if (i) collateralization was performed on a portfolio basis and there is no IM portfolio code, or (ii) it is a submission from a DCO.

⁴⁵ Both the date and time portion are required to be reported. The time element is as specific as technologically practicable. If the time portion is not available, report "00:00:00" for the time portion.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
96	CDE	Level	Indicator of whether the report is in respect of a derivative or a position.	Indication whether the report is done at trade or position level. Position level report can be used as a supplement to trade level reporting to report post trade events and if individual trades have been replaced by the position.	Char(4)	• TCTN = Trade • PSTN = Position	N	Transaction – M Collateral – NR Valuation - NR
97	CDE	Event identifier	Unique identifier that links derivatives relating to an event.	Unique identifier to link transactions entering into and resulting from an event, which may be, but is not limited to, compression or other post trade risk reduction exercises, credit event, etc. The unique identifier may be assigned by the reporting counterparty or a service provider or CCP providing the service ⁴⁶ .	Varchar(52)	ISO 17442 LEI code of the entity assigning the event identifier followed by a unique identifier up to 32 characters.	N	Transaction C if [Event type] = 'COMP' or 'CREV', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
98	CDE	Action type ⁴⁷	Indicator of the type of action or reporting relating to the derivative or position.	Type of action taken on the transaction or type of end-of-day reporting. See Appendix 3.8 for a description of the allowable values.	Char(4)	• NEWT = New • MODI = Modify • CORR = Correct • EROR = Error • REVI = Revive • TERM = Terminate • PRTO = Transfer out • VALU = Valuation • MARU = Collateral/ Margin Update • POSC = Position Component	Y	Transaction - M, for valid Action type and Event type, see Appendix 3.5 Collateral - M, must equal 'MARU' Valuation - M, must equal 'VALU'
99	CDE	Event type	Indicator of the type of lifecycle event or reason for the action referred to in Data Element Number 98.	Explanation or reason for the action being taken on the transaction. See Appendix 3.7 for a description of the allowable values.	Char(4)	• TRAD = Trade • NOVA = Novation/Step-in • COMP = Post trade risk reduction exercise • ETRM = Early termination • CLRG = Clearing • EXER = Exercise • ALOC = Allocation • CLAL = Clearing & Allocation • CREV = Credit Event • PTNG = Transfer • INCP = Inclusion in position • CORP = Corporate event • UPDT = Update	Y	Transaction C, for valid Action type and Event type, see Appendix 3.5 Collateral - NR Valuation - NR

⁴⁶ The identifier which relates to the same event should be unique per event.

⁴⁷ Only one Action type value is allowed per submission. Multiple Action type values should not be submitted in one transaction report. For example, if a data element needs to be corrected on a previously submitted transaction that is getting terminated, the Correct (CORR) value should be submitted as a separate submission prior to the submission of the Terminate (TERM) transaction.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
100	CFTC	Amendment indicator	Indicator of whether an amendment to the derivative relates to an event.	Indicator of whether the modification of the transaction reflects newly agreed upon term(s) from the previously negotiated terms.	Boolean	• True • False	Y	Transaction C if [Action type] = 'MOD', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Valuation

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
101	CDE	Valuation amount ⁴⁸	Value of the derivative.	Current value of the outstanding contract without applying any valuation adjustments (some examples include XVA adjustment such as CVA, DVA, etc). Valuation amount is expressed as the exit cost of the contract or components of the contract, as of a single moment in time, not a change in value or cumulative change in value over a specified period of time, i.e., the price that would be received to sell the contract (in the market in an orderly transaction at the valuation date). The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the valuation amount. In particular, the valuation amount of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model.	Num(25,5)	Any numerical value.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M
102	CDE	Valuation currency	Currency in which the valuation amount is denominated.	Currency in which the valuation amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M

⁴⁸ Valuation amount must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
103	CDE	Valuation method	Source and method used to value the derivative.	Source and method used for the valuation of the transaction by the reporting counterparty. If at least one valuation input is used that is classified as mark-to-model in Appendix 3.3, then the whole valuation is classified as mark-to-model. If only inputs are used that are classified as mark-to-market in Appendix 3.3, then the whole valuation is classified as mark-to-market.	Char(1)	• MTMA = Mark-to-market • MTMO = Mark-to-model • CCPV = Clearing agency's valuation (Classification of valuation inputs are provided in Appendix 3.3)	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M
104	CDE	Valuation timestamp	Date and time that the value of the derivative referred to in Data Element Number 101 was determined.	Date and time of the calculation of the last valuation marked to market, provided by the central counterparty (CCP) ⁴⁹ or calculated using the current or last available market price of the inputs.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC] ⁵⁰ . If the time element is not required in a particular jurisdiction, time may be dropped given that – in the case of representations with reduced accuracy – ISO 8601 allows the complete representation to be omitted, the omission starting from the extreme right-hand side (in the order from the least to the most significant).	Any valid date/time based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M
105	CFTC	Next floating reference reset date [Next floating reference reset date – Leg 1] [Next floating reference reset date – Leg 2]	Next date on which the floating reference will reset.	The nearest date in the future that the floating reference resets on.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O
106	CFTC	Last floating reference value [Last floating reference value-Leg 1] [Last floating reference value-Leg 2]	Value of the floating reference on the date referred to in Data Element Number 107.	The most recent sampling of the value of the floating reference for the purposes of determining cash flow. Ties to Last floating reference reset date data element.	Num(11,10)	Positive and negative values expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%)	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O
107	CFTC	Last floating reference reset date [Last floating reference reset date-Leg 1] [Last floating reference reset date-Leg 2]	Most recent date of the floating reference reset.	The date of the most recent sampling of the floating reference for the purposes of determining cash flow. Ties to Last floating reference value data element.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O

⁴⁹ Reported by the clearing agency for cleared derivatives and by the derivatives dealer for uncleared derivatives.

⁵⁰ The timestamp portion is not required to be represented for Valuation timestamp. The format must be reported as YYYY-MM-DD.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
108	CDE	Delta ⁵¹	Ratio of the change in the price of the derivative to the change in the price of the underlying interest of the derivative.	The ratio of the change in the price of an OTC derivative transaction to the change in the price of the underlier.	Num(25,5)	Any numeric value	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - C if UPI.[Instrument type] = 'Option', else {optional}

Data Elements Related to Packages

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
109	CFTC	Package indicator	Indicator of whether the derivative is a component of a package if (a) 2 or more derivatives that are reported separately by the reporting counterparty are entered into under a single agreement, or (b) 2 or more reports relate to the same derivative and the derivative cannot be reported using a single report as a result of the reporting requirements of one or more jurisdictions of Canada or one or more foreign jurisdictions.	Indicator of whether the swap transaction is part of a package transaction.	Boolean	• True • False	Y	Transaction - M Collateral - NR Valuation - NR
110	CDE	Package identifier ⁵²	Identifier of the package referred to in Data Element Number 109.	Identifier (determined by the reporting counterparty) in order to connect • two or more transactions that are reported separately by the reporting counterparty, but that are negotiated together as the product of a single economic agreement. • two or more reports pertaining to the same transaction whenever jurisdictional reporting requirement does not allow the transaction to be reported with a single report to trade repositories.	Varchar(100)	Up to 100 alphanumeric characters. ⁵⁴	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

⁵¹ Delta must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

⁵² To report a collar, this field should be populated to link the cap and floor legs. To report a straddle, this field should be populated to link the payer swaption and receiver swaption legs.

⁵⁴ "UNKNOWN" is accepted when the value is not available.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				A package⁵³ may include reportable and non-reportable transactions. This data element is not applicable • if no package is involved, or • to allocations Where the package identifier is not known when a new transaction is reported, the package identifier is updated as it becomes available.				
111	CDE	Package transaction price	Price of the package referred to in Data Element Number 109.	Traded price of the entire package in which the reported derivative transaction is a component. This data element is not applicable if • no package is involved, or • package transaction spread is used Prices and related data elements of the transactions (Price currency, Price notation, Price unit of measure) that represent individual components of the package are reported when available. The Package transaction price may not be known when a new transaction is reported but may be updated later	• Num(18,13), if Package transaction price notation = 1 • Num(11,10), if Package transaction price notation = 3⁵⁵	• Any value, if Package transaction price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Package transaction price notation = 3⁵⁵	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True' and [Package transaction spread] is not populated, else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
112	CDE	Package transaction price currency	Currency in which the package transaction price is denominated.	Currency in which the Package transaction price is denominated. This data element is not applicable if: • no package is involved, or • Package transaction spread is used, or • Package transaction price notation = 3	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - C if [Package transaction price notation] = '1', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
113	CDE	Package transaction spread	Price of the package referred to in Data Element 109, expressed as a spread.	Traded price of the entire package in which the reported derivative transaction is a component of a package transaction. Package transaction price when the price of the package is expressed as a spread, difference between two reference prices. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used Spread and related data elements of the transactions (spread currency) that represent individual components of the package are reported when available.	• Num(18,13), if Package transaction spread notation = 1 • Num(11,10), if Package transaction spread notation = 3 • Num(5), if Package transaction spread notation = 4	• Any value, if Package transaction spread notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g. 0.0257 instead of 2.57%), Package spread price notation = 3 • Any integer value expressed in basis points (e.g. 257 instead of 2.57%), if Package transaction spread notation = 4	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True' and [Package transaction price] is not populated, else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

⁵³ In addition, a "package transaction" also includes a transaction involving two or more instruments: (1) that is executed between two or more counterparties; (2) that is priced or quoted as one economic transaction with simultaneous or near simultaneous execution of all components; (3) where the execution of each component is contingent upon the execution of all other components; (4) where each component is assigned a Unique Swap Identifier (USI) or Unique Transaction Identifier (UTI); and (5) each component is reported separately.

⁵⁵ Default value with all 9's, for any of the allowable formats, is accepted when the value is unknown. When [Package transaction price notation] = '1' use "99999.9999999999999" (18 numerical characters including 13 decimal places). When [Package transaction price notation] = '3' use "9.999999999" (11 numerical characters including 10 decimal places).

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				Package transaction spread may not be known when a new transaction is reported but may be updated later. ⁵⁶				
114	CDE	Package transaction spread currency	Currency in which the package transaction spread is denominated.	Currency in which the Package transaction spread is denominated. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used, or • Package transaction spread is expressed as decimal or basis points	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction - C if [Package transaction price notation] = '1', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
115	CDE	Package transaction spread notation	Manner in which the package transaction spread is expressed.	Manner in which the Package transaction spread is expressed. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal • 4 = Basis points	N	Transaction - C if [Package transaction spread] is populated, else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
116	CDE	Package transaction price notation	Manner in which the package transaction price is expressed.	Manner in which the Package transaction price is expressed. This data element is not applicable if no package is involved	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal	N	Transaction - C if [Package transaction price] is populated, else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

⁵⁶ Default value with all 9's, for any of the allowable formats, is accepted when the value is unknown. When [Package transaction price notation] = '1' use "99999.99999999999999" (18 numerical characters including 13 decimal places). When [Package transaction price notation] = '3' use "9.9999999999" (11 numerical characters including 10 decimal places). When [Package transaction spread notation] = '4' use "99999" (5 numerical characters with no decimal places).

Data Elements Related to Product

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
117	CDE	Unique product identifier ⁵⁷	Identifier of a unique code assigned by the Derivatives Service Bureau for a type of derivative.	A unique set of characters that represents a particular OTC derivative.	Char(12)	A list of allowable values and their format will be published by the Derivatives Service Bureau (UPI issuer). Until the above UPI is available reporting counterparties will continue to report the product-related data elements unique to each TR.	Y	Transaction- M Collateral - NR Valuation - M
118	CDE	CDS index attachment point	Point at which the level of losses in the underlying portfolio of a credit default swap reduces the notional of a tranche.	Defined lower point at which the level of losses in the underlying portfolio reduces the notional of a tranche. For example, the notional in a tranche with an attachment point of 3% will be reduced after 3% of losses in the portfolio have occurred. This data element is not applicable if the transaction is not a CDS tranche transaction (index or custom basket).	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	N	Transaction - CR C if UPI. Underlier type = 'Index tranche', else {optional}; When populated, the value shall be less than the value in [CDS index detachment point]. Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral - NR Valuation - NR
119	CDE	CDS index detachment point	Point beyond which losses in the underlying portfolio of a credit default swap no longer reduce the notional of a tranche.	Defined point beyond which losses in the underlying portfolio no longer reduce the notional of a tranche. For example, the notional in a tranche with an attachment point of 3% and a detachment point of 6% will be reduced after there have been 3% of losses in the portfolio. 6% losses in the portfolio deplete the notional of the tranche. This data element is not applicable if the transaction is not a CDS tranche transaction (index or custom basket).	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	N	Transaction - CR C if UPI. Underlier type = 'Index tranche', else {optional}; When populated, the value shall be greater than the value in [CDS index attachment point]. Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral -NR Valuation -NR

⁵⁷ On February 20, 2025, the CSA published Coordinated Blanket Order 96-933 Re Temporary Exemptions from Derivatives Data Reporting Requirements Relating to the Unique Product Identifier for Commodity Derivatives. The Coordinated Blanket Order enables market participants to continue to report unique product identifiers for commodity derivatives as required under rules in effect at that time: <https://www.securities-administrators.ca/news/csa-announces-temporary-exemptions-for-derivatives-market-participants/>

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
120	CFTC	Index factor	Factor of the index version, or the percentage, used to determine the notional amount of a credit default swap.	The index version factor or percent, expressed as a decimal value, that multiplied by the Notional amount yields the notional amount covered by the seller of protection for credit default swap.	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	Y	Transaction - CR C if UPI.Underlier type= 'Index' or 'Index tranche', else {optional} Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral NR Valuation NR
121	CDE	Crypto asset underlying indicator [Crypto asset underlying indicator – Leg 1] [Crypto asset underlying indicator – Leg 2]	Indicator of whether the underlying interest of the derivative is a crypto asset.	Indicator of whether the underlying of the derivative is crypto asset. This element should be reported as 'true' if any of the underlyings is a crypto asset (immediate or ultimate underlying as well as where the derivative is based on a mix of crypto assets and other underlyings).	Boolean	• True, if underlying is a crypto asset • False, if underlying is not crypto asset	N	Transaction – CO M Collateral – NR Valuation - NR
122	CDE	Custom basket code	Unique identifier for a custom basket of reference assets.	If the OTC derivative transaction is based on a custom basket, unique code assigned by the structurer of the custom basket to link its constituents. This data element is not applicable if no custom basket is involved or no unique code has been assigned to it.	Varchar(72)	ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) code of the basket structurer ⁵⁸ followed by a unique identifier up to 52 alphanumeric characters.	N	Transaction – C if [Custom basket indicator] = 'True', else {optional} Collateral – NR Valuation – NR
123	CFTC	Custom basket indicator	Indicator of whether the derivative has a custom basket as its underlying interest.	Indicator of whether the swap transaction is based on a custom basket.	Boolean	• True • False	Y	Transaction -M Collateral - NR Valuation - NR
124	CDE	Basket constituent identifier	Identifier of a reference asset in the custom basket.	An identifier that represents a constituent of an underlying custom basket in line with the Underlier ID within the ISO 4914 UPI reference data elements, as maintained by the UPI Service Provider or in line with an identifier that would be reported as an Underlier ID (Other) where the UPI Underlier ID is 'OTHER'. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Varchar(210) ⁵⁹	An identifier that can be used to determine an asset, index or benchmark included in a basket. ⁶⁰	N	Transaction – C if [Custom basket code] = 'True', else {optional} The number of constituent identifier values must equal the number of constituent unit of measure, number of

⁵⁸ The LEI code should represent the LEI of the entity assigning the basket code.

⁵⁹ Free-form text is permitted in this field.

⁶⁰ In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								units, and identifier source values. Collateral – NR Valuation - NR
125	CDE	Basket constituent identifier source	Source of the basket constituent identifier referred to in Data Element Number 124.	The origin, or publisher, of the associated Basket constituent identifier, in line with the Underlier ID source within the ISO 4914 UPI reference data elements as maintained by the UPI Service Provider or in line with the allowable value that would be reported as an Underlier ID (Other) source where the UPI Underlier ID is 'OTHER'. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Varchar(100) ⁶¹	The origin, or publisher ⁶² , of the associated basket constituent identifier.	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else {optional} The number of constituent identifier source values must equal the number of constituent identifier, unit of measure and number of units values. Collateral - NR Valuation - NR
126	CDE	Basket constituent number of units	Number of units of each reference asset in the custom basket.	The number of units of a particular constituent in a custom basket. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Num(18,13)	Any value greater than zero. ⁶³	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else {optional} The number of constituent number of units values must equal the number of constituent identifier, unit of measure, and identifier source values. Collateral – NR Valuation - NR
127	CDE	Basket constituent unit of measure	Unit of measure in which the number of units referred to in Data Element Number 126 is expressed.	Unit of measure in which the number of units of a particular custom basket constituent is expressed. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Varchar(4)	ISO 20022 approved external UnitOfMeasureCode codeset ⁶⁴	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else {optional} The number of constituent unit of measure values must equal the number of constituent identifier, number of units, and identifier source values.

⁶¹ Free-form text is permitted in this field.

⁶² In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶³ For commodities baskets where calculated formula of different % weights of indices are used, provide values without the %. For example, 10% should be reported as "10".

⁶⁴ Other TR approved UnitOfMeasure codes (related to crypto transactions) are allowed for CSA.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Collateral – NR Valuation – NR
128	CDE	Underlier ID (Other) [Underlier ID (Other) – Leg 1] [Underlier ID (Other) – Leg 2]	Identifier of each underlying interest of the derivative.	The asset(s), index (indices) or benchmark underlying a contract or, in the case of a foreign exchange derivative, identification of index. This data element is applicable when the value of Underlier ID is submitted as 'OTHER' to the UPI service provider. ⁶⁵	Varchar(210) ⁶⁶	An identifier ⁶⁷ that can be used to determine the asset(s), index (indices) or benchmark underlying a contract. Up to 210 alphanumeric characters. For an 'Underlier ID' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier IDs see 3.9 in the Appendix.	N	Transaction – C if UPI.[Underlier ID ⁶⁸] = 'Other', else {optional} Collateral – NR Valuation - NR
129	CDE	Underlier ID (Other) source [Underlier ID (Other) source – Leg 1] [Underlier ID (Other) source – Leg 2]	Source of the Underlier ID (Other) referred to in Data Element Number 128.	The origin, or publisher, of the associated Underlier ID (Other). This data element is applicable when the value of Underlier ID source is submitted as 'OTHER' to the UPI service provider.	Varchar(100) ⁶⁹	The origin, or publisher ⁷⁰ , of the associated Underlier ID. Up to 100 alphanumeric characters. For an 'Underlier ID source' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier ID source see 3.10 in the Appendix.	N	Transaction – C if [Underlier ID (Other)] is populated, else {blank} Collateral – NR Valuation - NR
130	CDE	Underlying asset trading platform identifier [Underlying asset trading platform identifier – Leg 1] [Underlying asset trading platform identifier – Leg 2]	Identifier of the platform on which the underlying interest referred to in Data Element Number 128 is traded.	For a platform (e.g. exchange) traded underlying asset, the platform on which the asset is traded. ⁷¹ This data element is not applicable to OTC derivative transactions with custom basket constituents.	Char(4)	ISO 10383 Segment Market Identifier Code (MIC)	N	Transaction – O Collateral – NR Valuation - NR

⁶⁵ When a particular underlier ID is not supported by the UPI service provider (Underlier ID is 'Other'), that underlier ID is reported in this field to the trade repository.

⁶⁶ Free-form text is permitted in this field.

⁶⁷ In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶⁸ Depending on the product DSB may use attributes with names such as Reference Rate, Underlying Instrument Index, Underlying instrument ISIN, Underlying instrument LEI, or another name to denote the asset or index underlying the derivative.

⁶⁹ Free-form text is permitted in this field.

⁷⁰ In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁷¹ The platform provided should be the platform from where the underlying asset gets its pricing information.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
131	CDE	Underlying asset price source [Underlying asset price source – Leg 1] [Underlying asset price source – Leg 2]	Source of the price used to determine the value or level of the underlying interest referred to in Data Element Number 128.	For an underlying asset or benchmark not traded on a platform, the source of the price used to determine the value or level of the asset or benchmark. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with custom basket constituents.	Varchar(50) ⁷²	Up to 50 alphanumeric characters.	N	Transaction – O Collateral – NR Valuation – NR
132	CFTC	Embedded option type	Type of optional provision in a derivative.	Type of option or optional provision embedded in a contract.	Char(4)	• MDET = Mandatory early termination • OPET = Optional early termination • CANC = Cancelable • EXT D = Extendible • OTHR = Other	Y	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Payments and Settlement

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
133	CDE	Final contractual settlement date	Date in the agreement by which all obligations under the derivative are to be satisfied.	Unadjusted date as per the contract, by which all transfer of cash or assets should take place and the counterparties should no longer have any outstanding obligations to each other under that contract. For products that may not have a final contractual settlement date (e.g., American options), this data element reflects the date by which the transfer of cash or asset would take place if termination were to occur on the expiration date.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date.	N	Transaction - C if UPI.[ReturnorPayoutTrigger] ≠ 'Contract for Difference (CFD)', else {optional}. When populated, - the value shall be equal to or later than the value in [Expiration date]. Collateral - NR Valuation - NR
134	CDE	Settlement location	Place of settlement of the derivative.	Place of settlement of the transaction as stipulated in the contract. This data element is only applicable for transactions that involve an offshore currency (i.e. a currency which is not included in the ISO 4217 currency list, for example CNH).	Char(2)	ISO 3166 Country codes (using two-letter code (alpha-2))	N	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR

⁷² Free-form text is permitted in this field.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
135	CDE	Settlement currency [Settlement currency-Leg 1] [Settlement currency-Leg 2]	For each leg of the derivative, the currency in which the cash settlement is denominated.	Currency for the cash settlement of the transaction when applicable. For multi-currency products that do not net, the settlement currency of each leg. This data element is not applicable for physically settled products (e.g., physically settled swaptions).	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	Y	Transaction - C if UPI.[Delivery type] = 'Cash', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
136	CDE	Other payment amount ⁷³	Amount of each payment under the derivative except an option premium amount under Data Element Number 144.	Payment amounts with corresponding payment types to accommodate requirements of transaction descriptions from different asset classes.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction - C if [Other payment type] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
137	CDE	Other payment currency	Currency in which the other payment amount referred to in Data Element Number 136 is denominated.	Currency in which Other payment amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
138	CDE	Other payment date	Date on which the other payment amount referred to in Data Element Number 136 is to be paid.	Unadjusted date on which the Other payment amount is paid.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR

⁷³ The set of data elements related to other payments (Other payment type [#141], Other payment amount [#142], Other payment currency [#143], Other payment date [#144], Other payment payer [#139], Other payment receiver [#140]) can be reported multiple times in the case of multiple payments.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
139	CDE	Other payment payer	Identifier of the payer of the other payment amount referred to in Data Element Number 136.	Identifier of the payer of Other payment amount.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
140	CDE	Other payment receiver	Identifier of the receiver of the other payment amount referred to in Data Element Number 136.	Identifier of the receiver of Other payment amount.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
141	CDE	Other payment type	Reason for the payment referred to in Data Element Number 136.	Type of Other payment amount. Option premium payment is not included as a payment type as premiums for option are reported using the option premium dedicated data element.	Char(4)	• UFRO = Upfront Payment, i.e., the initial payment made by one of the counterparties either to bring a transaction to fair value or for any other reason that may be the cause of an off-market transaction • UWIN = Unwind or Full termination, i.e., the final settlement payment made when a transaction is unwound prior to its end date; Payments that may result due to full termination of derivative transaction(s) • PEXH = Principal Exchange, i.e., Exchange of notional values for cross-currency swaps	Y	Transaction - CR C, at least one is required: ([Fixed rate] or [Spread] or [Other payment type] = 'UFRO'), else {optional} Allowable values UWIN' and PEXH' are optional and independent of the above condition Transaction – IR/FX/EQ/CO O Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
142	CDE	Payment frequency period ⁷⁴ [Fixed rate payment frequency period-Leg 1] [Fixed rate payment frequency period-Leg 2] [Floating rate payment frequency period-Leg 1] [Floating rate payment frequency period-Leg 2]	For each leg of a derivative, the unit of time of the frequency of payments.	For each leg of the transaction, where applicable: time unit associated with the frequency of payments, e.g., day, week, month, year or term of the stream.	Char(4)	• DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • YEAR = Yearly • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular • EXPI⁷⁵ = Payment at term	Y	Transaction – CR/IR/EQ/CO O Transaction – FX - NR Collateral - NR Valuation - NR
143	CDE	Payment frequency period multiplier [Fixed rate payment frequency period multiplier-Leg 1] [Fixed rate payment frequency period multiplier-Leg 2] [Floating rate payment frequency period multiplier-Leg 1] [Floating rate payment frequency period multiplier-Leg 2]	For each leg of a derivative, the number by which the payment frequency period is multiplied to determine the frequency of periodic payment dates.	For each leg of the transaction, where applicable: number of time units (as expressed by the Payment frequency period) that determines the frequency at which periodic payment dates occur. For example, a transaction with payments occurring every two months is represented with a Payment frequency period of "MNTH" (monthly) and a Payment frequency period multiplier of 2. This data element is not applicable if the Payment frequency period is "ADHO." If Payment frequency period is "EXPI", then the Payment frequency period multiplier is 1. If the Payment frequency is intraday, then the Payment frequency period is "DAIL" and the Payment frequency multiplier is 0.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction – CR/IR/EQ/CO C if [Payment frequency period] ≠ 'ADHO', else {blank}. When [Payment frequency period] is populated with 'EXPI', [Payment frequency period multiplier] must be '1' Transaction – FX - NR Collateral - NR Valuation - NR
144	CDE	Option premium amount	Premium paid by a buyer of an option or swaption.	For options and swaptions of all asset classes, monetary amount paid by the option buyer. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction C if UPL.[Instrument type] = 'Option', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
145	CDE	Option premium currency	Currency in which the premium referred to in Data Element Number 144 is denominated.	For options and swaptions of all asset classes, currency in which the option premium amount is denominated. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction C if [Option premium amount] > 0, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR

⁷⁴ To represent quarterly payment, report [Payment frequency period] = 'MNTH' and [Payment frequency period multiplier] = '3'. For semi-annual payment, report [Payment frequency period] = 'MNTH' and [Payment frequency period multiplier] = '6'.

⁷⁵ Throughout this Technical Manual, for the allowable value 'EXPI' in frequency period related data elements, two different descriptions 'Payment at term' and 'End of term' are being used which in essence has the same meaning and represents the frequency/rate of payment/quantity.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
146	CDE	Option premium payment date	Date on which the premium referred to in Data Element Number 144 is paid.	Unadjusted date on which the option premium is paid.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if {Option premium amount} > 0, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
147	CDE	First exercise date	First date on which an option can be exercised.	First unadjusted date during the exercise period in which an option can be exercised. For European-style options, this date is same as the Expiration date. For American-style options, the first possible exercise date is the unadjusted date included in the Execution timestamp. For knock-in options, where the first exercise date is not known when a new transaction is reported, the first exercise date is updated as it becomes available. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction C if UPI.[Instrument type] = 'Option', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR
148	CFTC	Fixing date [Fixing date-Leg 1] [Fixing date-Leg 2]	For each leg of a derivative, the date on which the reference rate is determined.	Describes the specific date when a non-deliverable forward as well as various types of FX OTC options such as cash-settled options will "fix" against a particular exchange rate, which will be used to compute the ultimate cash settlement.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction – CR/IR/EQ/CO O Transaction - FX C if (UPI.[Instrument type] = 'Forward' or 'Option') and UPI.[Delivery type] = 'Cash', else {optional} Collateral - NR Valuation - NR

2.1 Position reporting guidelines

Data Element Name	Detailed Explanation of Data Element	Position Reporting
Buyer identifier	Identifier of the counterparty that is the buyer, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps	Where Buyer Identifier is applicable, the buyer/seller determination is made on the net of all position components.

	• contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	
Seller identifier	Identifier of the counterparty that is the seller as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	Where Seller Identifier is applicable, the buyer/seller determination is made on the net of all position components.
Payer identifier [Payer identifier–Leg 1] [Payer identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the payer leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	Where Payer Identifier is applicable, the payer/receiver determination is made on the net of all position components.
Receiver identifier [Receiver identifier–Leg 1] [Receiver identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the receiver leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	Where Receiver Identifier is applicable, the payer/receiver determination is made on the net of all position components.
Effective date	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction come into effect, as included in the confirmation.	Effective date initially reported when position was entered into.
Unique transaction identifier (UTI)	A unique identifier assigned to all derivatives reported at the transaction or position level which identifies it uniquely throughout its lifecycle and used for all recordkeeping.	New UTI created for position.
Notional amount [Notional amount–Leg 1] [Notional amount–Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: • For OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts, the amount specified in the contract. • For OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts, refer to Appendix 3.1 for converting notional amounts for non-monetary amounts. In addition: • For OTC derivative transactions with a notional amount schedule, the initial notional amount, agreed by the counterparties at the inception of the transaction, is reported in this data element • For OTC foreign exchange options, in addition to this data element, the amounts are reported using the data elements Call amount and Put amount • For amendments or lifecycle events, the resulting outstanding notional amount is reported; (steps in notional amount schedules are not considered to be amendments or lifecycle events) • Where the notional amount is not known when a new transaction is reported, the notional amount is updated as it becomes available.	The notional amount is calculated as the net of buyer/seller or payer/receiver position components.
Call amount	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to buy.	The call amount is calculated as the sum of all call amounts included in the position.
Put amount	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to sell.	The put amount is calculated as the sum of all put amounts included in the position.
Notional quantity [Notional quantity–Leg 1] [Notional quantity–Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable, for derivative transactions negotiated in non-monetary amounts with fixed notional quantity for each schedule period (e.g., 50 barrels per month). The frequency is reported in Quantity frequency and the unit of measure is reported in Quantity unit of measure.	The notional quantity is calculated as the net of buyer/seller position components' notional quantity.

Total notional quantity [Total notional quantity-Leg 1] [Total notional quantity-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: aggregate Notional quantity of the underlying asset for the term of the transaction. Where the Total notional quantity is not known when a new transaction is reported, the Total notional quantity is updated as it becomes available.	The total notional quantity is calculated as the net of buyer/seller position components' total notional quantity.
Price	Price specified in the OTC derivative transaction. It does not include fees, taxes or commissions. For commodity fixed/float swaps and similar products with periodic payments, this data element refers to the fixed price of the fixed leg(s). For commodity and equity forwards and similar products, this data element refers to the forward price of the underlying or reference asset. For equity swaps, portfolios swaps, and similar products, this data element refers to the initial price of the underlying or reference asset. For contracts for difference and similar products, this data element refers to the initial price of the underlier. This data element is not applicable to: • Interest rate swaps and forward rate agreements, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate and Spread may be interpreted as the price of the transaction. • Interest rate options and interest rate swaptions as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Commodity basis swaps and the floating leg of commodity fixed/float swaps as it is understood that the information included in the data element Spread may be interpreted as the price of the transaction. • Foreign exchange swaps, forwards and options, as it is understood that the information included in the data elements Exchange rate, Strike price, and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Equity options as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Credit default swaps and credit total return swaps, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate, Spread and Upfront payment (Other payment type: Upfront payment) may be interpreted as the price of the transaction. • Commodity options, as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. Where the price is not known when a new transaction is reported, the price is updated as it becomes available. For transactions that are part of a package, this data element contains the price of the component transaction where applicable.	Volume Weighted Average Price.
Spread [Spread-Leg 1] [Spread-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments (e.g. interest rate fixed/float swaps, interest rate basis swaps, commodity swaps), • spread on the individual floating leg(s) index reference price, in the case where there is a spread on a floating leg(s). For example, USD-LIBOR-BBA plus .03 or WTI minus USD 14.65; or • difference between the reference prices of the two floating leg indexes. For example, the 9.00 USD "Spread" for a WCS vs. WTI basis swap where WCS is priced at 43 USD and WTI is priced at 52 USD.	Volume Weighted Average Spread.
Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the clearing agency, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin posted for all derivatives in the same position.
Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the clearing agency, i.e., committed credit lines.	Sum of initial margin posted for all derivatives in the same position.

	If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	
Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the clearing agency as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin collected for all derivatives in the same position.
Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the clearing agency as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin collected for all derivatives in the same position.
Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the counterparty 1 (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of posted variation margins for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Sum of variation margin posted for all derivatives in the same position.
Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of variation margins posted for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of variation margin posted for all derivatives in the same position.
Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the counterparty 1 (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin collected after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Sum of variation margin collected for all derivatives in the same position.
Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of variation margin collected for all derivatives in the same position.
Valuation amount	Current value of the outstanding contract. Valuation amount is expressed as the exit cost of the contract or components of the contract, i.e., the price that would be received to sell the contract (in the market in an orderly transaction at the valuation date).	Sum of valuation amounts for all derivatives in the position or valuation of the position itself if it is evaluated as a single element.

Final contractual settlement date	Unadjusted date as per the contract, by which all transfer of cash or assets should take place and the counterparties should no longer have any outstanding obligations to each other under that contract. For products that may not have a final contractual settlement date (e.g., American options), this data element reflects the date by which the transfer of cash or asset would take place if termination were to occur on the expiration date.	Maximum of all final contractual settlement dates of all derivatives in the position.
-----------------------------------	--	---

3 Appendix

From Revised CDE Technical Guidance – version 4: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)⁷⁶

3.1 Notional amount

Product	Converted Amount
Equity options and similar products	Product of the strike price and the number of shares or index units
Equity forwards and similar products	Product of the forward price and the number of shares or index units
Equity dividend swaps and similar products	Product of the period fixed strike and the number of shares or index units
Equity swaps, portfolio swaps, and similar products	Product of the initial price and the number of shares or index units
Equity variance swaps and similar products	Vega notional amount
Equity volatility swaps and similar products	Vega notional amount
Equity CFDs and similar products	Product of the initial price and the number of shares or index units
Commodity options and similar products	Product of the strike price, and the total notional quantity
Commodity forwards and similar products	Product of the forward price and the total notional quantity
Commodity fixed/float swaps and similar products	Product of the fixed price and the total notional quantity
Commodity basis swaps and similar products	Product of the last available spot price at the time of the transaction of the underlying asset of the leg with no spread and the total notional quantity of the leg with no spread
Commodity swaptions and similar products	Notional amount of the underlying contract
Commodity CFDs and similar products	Product of the initial price and the total notional quantity

Notes to the conversion table for derivatives negotiated in non-monetary amounts:

Note 1: for derivatives where the quantity unit of measure differs from the price unit of measure, the price or total quantity is converted to a unified unit of measure.

Note 2: if applicable to the derivative, the notional amount reflects any multipliers and option entitlements.

Note 3: for basket-type contracts, the notional amount of the derivative is the sum of the notional amounts of each constituent of the basket.

⁷⁶ CDE Technical Guidance – version 4: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI), https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf

3.2 Mapping of Day count convention allowable values to ISO 20022, FpML, and FIX/FIXML values

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A001	IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February, and provided that the interest period started on a 30th or a 31st. This means that a 31st is assumed to be a 30th if the period started on a 30th or a 31st and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). This is the most commonly used 30/360 method for US straight and convertible bonds.	1	30/360 (30U/360 Bond Basis)	Mainly used in the United States with the following date adjustment rules: (1) If the investment is End-Of-Month and Date1 is the last day of February and Date2 is the last day of February, then change Date2 to 30; (2) If the investment is End-Of-Month and Date1 is the last day of February, then change Date1 to 30; (3) If Date2 is 31 and Date1 is 30 or 31, then change Date2 to 30; (4) If Date1 is 31, then change Date1 to 30. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f). [Symbolic name: ThirtyThreeSixtyUS]	30/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e). The number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360, calculated on a formula basis as follows: Day Count Fraction = $[360 \times (Y2 - Y1) + 30 \times (M2 - M1) + (D2 - D1)] / 360$ "D1" is the first calendar day, expressed as a number, of the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D1, will be 30; and "D2" is the calendar day, expressed as a number, immediately following the last day included in the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31 and D1 is greater than 29, in which case D2 will be 30 ⁸⁰
A002	IC30365	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month in a way similar to the 30/360 (basic rule) and a 365-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that a 31st is assumed to be the 30th and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th).					

⁷⁷ The information contained in this column refers to the ISO 20022 data dictionary.

⁷⁸ The source of information contained in this column is FIX Trading Community, <http://fixmate.fixtrading.org/latestEP/>

⁷⁹ The definitions contained herein are copyright 2006 by International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) and reproduced by permission of ISDA. All Rights Reserved.

⁸⁰ Note that the algorithm defined for this day count fraction has changed between the 2000 ISDA Definitions and 2006 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A003	IC30Actual	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month in a way similar to the 30/360 (basic rule) and the assumed number of days in a year in a way similar to the Actual/Actual (ICMA). Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). The assumed number of days in a year is computed as the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of interest payments in the year.					
A004	Actual360	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period and a 360-day year.	6	Act/360	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 360. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e). [Symbolic name: ActThreeSixty]	ACT/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360.
A005	Actual365Fixed	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period and a 365-day year.	7	Act/365 (FIXED)	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 365. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d). [Symbolic name: ActThreeSixtyFiveFixed]	ACT/365. FIXED	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A006	ActualActualICMA	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and the assumed number of days in a year, i.e., the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of interest payments in the year. If the coupon period is irregular (first or last coupon), it is extended or split into quasi-interest periods that have the length of a regular coupon period and the computation is operated separately on each quasi-interest period and the intermediate results are summed up.	9	Act/Act (ICMA)	The denominator is the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of coupon periods in the year. Assumes that regular coupons always fall on the same day of the month where possible. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). [Symbolic name: ActActICMA]	ACT/ACT. ICMA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). This day count fraction code is applicable for transactions booked under the 2006 ISDA Definitions. Transactions under the 2000 ISDA Definitions should use the ACT/ACT.ISMA code instead. A fraction equal to "number of days accrued/number of days in year", as such terms are used in Rule 251 of the statutes, by-laws, rules and recommendations of the International Capital Markets Association (the "ICMA Rule Book"), calculated in accordance with Rule 251 of the ICMA Rule Book as applied to non-US dollar-denominated straight and convertible bonds issued after 31 December 1998, as though the interest coupon on a bond were being calculated for a coupon period corresponding to the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made.
A007	IC30E360orEuroBondBasismodel1	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. However, if the last day of the maturity coupon period is the last day of February, it will not be assumed to be the 30th. It is a variation of the 30/360 (ICMA) method commonly used for eurobonds. The usage of this variation is only relevant when the coupon periods are scheduled to end on the last day of the month.	5	30E/360 (ISDA)	Date adjustment rules are: (1) if Date1 is the last day of the month, then change Date1 to 30; (2) if D2 is the last day of the month (unless Date2 is the maturity date and Date2 is in February), then change Date2 to 30. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (h). [Symbolic name: ThirtyEThreeSixtyISDA]	30E/360.I SDA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (h). Note the algorithm for this day count fraction under the 2006 ISDA Definitions is designed to yield the same results in practice as the version of the 30E/360 day count fraction defined in the 2000 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change. The number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360, calculated on a formula basis as follows: $\text{Day Count Fraction} = [360 \times (Y2 - Y1) + 30 \times (M2 - M1) + (D2 - D1)] / 360$. "D1" is the first calendar day, expressed as a number, of the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D1, will be 30; "D2" is the calendar day, expressed as a number, immediately following the last day included in the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D2 will be 30.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A008	ActualActualISDA	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days of the interest period that fall (falling on a normal year, year) divided by 365, added to the actual number of days of the interest period that fall (falling on a leap year, year) divided by 366.	11	Act/Act (ISDA)	The denominator varies depending on whether a portion of the relevant calculation period falls within a leap year. For the portion of the calculation period falling in a leap year, the denominator is 366 and for the portion falling outside a leap year, the denominator is 365. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b). [Symbolic name: ActActISDA]	ACT/ACT. ISDA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b). Note that going from FpML 2.0 Recommendation to the FpML 3.0 Trial Recommendation the code in FpML 2.0 "ACT/365.ISDA" became "ACT/ACT.ISDA". The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365 (or, if any portion of that Calculation Period or Compounding Period falls in a leap year, the sum of (i) the actual number of days in that portion of the Calculation Period or Compounding Period falling in a leap year divided by 366 and (ii) the actual number of days in that portion of the Calculation Period or Compounding Period falling in a non-leap year divided by 365).
A009	Actual365LorActuActubasisRule	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and a 365-day year (if the coupon payment date is NOT in a leap year) or a 366-day year (if the coupon payment date is in a leap year).	14	Act/365L	The number of days in a period equal to the actual number of days. The number of days in a year is 365, or if the period ends in a leap year 366. Used for sterling floating rate notes. May also be referred to as ISMA Year. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (i). [Symbolic name: ActThreeSixtyFiveL]	ACT/365L	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (i). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365 (or, if the later Period End Date of the Calculation Period or Compounding Period falls in a leap year, divided by 366).

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A010	ActualActualAFB	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and a 366-day year (if 29 Feb falls in the coupon period) or a 365-day year (if 29 Feb does not fall in the coupon period). If a coupon period is longer than one year, it is split by repetitively separating full year subperiods counting backwards from the end of the coupon period (a year backwards from 28 Feb being 29 Feb, if it exists). The first of the subperiods starts on the start date of the accrued interest period and thus is possibly shorter than a year. Then the interest computation is operated separately on each subperiod and the intermediate results are summed up.	8	Act/Act (AFB)	The actual number of days between Date1 and Date2, the denominator is either 365 (if the calculation period does not contain 29 February) or 366 (if the calculation period includes 29 February). See also AFB Master Agreement for Financial Transactions - Interest Rate Transactions (2004) in Section 4. Calculation of Fixed Amounts and Floating Amounts, paragraph 7 Day Count Fraction, subparagraph (i). [Symbolic name: ActActAFB]	ACT/ACT. AFB	The Fixed/Floating Amount will be calculated in accordance with the "BASE EXACT/EXACT" day count fraction, as defined in the "Définitions Communes plusieurs Additifs Techniques" published by the Association Française des Banques in September 1994. The denominator is either 365 (if the calculation period does not contain 29 February) or 366 (if the calculation period includes 29 February) – where a period of longer than one year is involved, two or more calculations are made: interest is calculated for each full year, counting backwards from the end of the calculation period, and the remaining initial stub period is treated in accordance with the usual rule. When counting backwards for this purpose, if the last day of the relevant period is 28 February, the full year should be counted back to the previous 28 February unless 29 February exists, in which case, 29 February should be used.
A011	IC30360ICMAor30360basicrule	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). It is the most commonly used 30/360 method for non-US straight and convertible bonds issued before 1 January 1999.	4	30E/360 (Eurobond Basis)	Also known as 30/360.ISMA, 30S/360, or Special German. Date adjustment rules are: (1) If Date1 falls on the 31st, then change it to the 30th; (2) If Date2 falls on the 31st, then change it to the 30th. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (g). [Symbolic name: ThirtyEThreeSixty]	30E/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (g) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f). Note that the algorithm defined for this day count fraction has changed between the 2000 ISDA Definitions and 2006 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A012	IC30E2360orEurobondbasismodel2	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for the last day of February whose day of the month value shall be adapted to the value of the first day of the interest period if the latter is higher and if the period is one of a regular schedule. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb of a non-leap year is assumed to be equivalent to 29 Feb when the first day of the interest period is the 29th, or to 30 Feb when the first day of the interest period is the 30th or the 31st. The 29th day of February in a leap year is assumed to be equivalent to 30 Feb when the first day of the interest period is the 30th or the 31st. Similarly, if the coupon period starts on the last day of February, it is assumed to produce only one day of interest in February as if it was starting on 30 Feb when the end of the period is the 30th or the 31st, or two days of interest in February when the end of the period is the 29th, or three days of interest in February when it is 28 Feb of a non-leap year and the end of the period is before the 29th.					

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A013	IC30E3360orEurobondbasismodel3	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. It is a variation of the 30E/360 (or Eurobond basis) method where the last day of February is always assumed to be the 30th, even if it is the last day of the maturity coupon period.					
A014	Actual365NL	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period, excluding any leap day from the count, and a 365-day year.	15	NL365	The number of days in a period equal to the actual number of days, with the exception of leap days (29 February) which are ignored. The number of days in a year is 365, even in a leap year. [Symbolic name: NLThreeSixtyFive]		
A015	ActualActualUltimo	Method whereby interest is calculated based on the actual number of days in the coupon period divided by the actual number of days in the year. This method is a variation of the ActualActualICMA method with the exception that it assumes that the coupon always falls on the last day of the month. Method equal to ACT/ACT.ISMA in the FpML model and Act/Act (ICMA Ultimo) in the FIX/FIXML model.	10	Act/Act (ICMA Ultimo)	The Act/Act (ICMA Ultimo) differs from Act/Act (ICMA) method only that it assumes that regular coupons always fall on the last day of the month. [Symbolic name: ActActISMAUltimo]	ACT/ACT. ISMA	The Fixed/Floating Amount will be calculated in accordance with Rule 251 of the statutes, by-laws, rules and recommendations of the International Securities Market Association, as published in April 1999, as applied to straight and convertible bonds issued after 31 December 1998, as though the Fixed/Floating Amount were the interest coupon on such a bond. This day count fraction code is applicable for transactions booked under the 2000 ISDA Definitions. Transactions under the 2006 ISDA Definitions should use the ACT/ACT.ICMA code instead.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
A016	IC30EPlus360	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. This method is a variation of the 30E360 method with the exception that if the coupon falls on the last day of the month, change it to 1 and increase the month by 1 (i.e., next month). Method equal to ThirtyEPlusThreeSixty in the FIX/FIXML model.	13	30E+/360	Variation on 30E/360. Date adjustment rules: (1) If Date1 falls on the 31st, then change it to the 30th; (2) If Date2 falls on the 31st, then change it to 1 and increase Month2 by one, i.e., next month. [Symbolic name: ThirtyEPlusThreeSixty]		
A017	Actual364	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period divided by 364. Method equal to Act364 in the FIX/FIXML model.	17	Act/364	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 364. [Symbolic name: Act364]		
A018	Business252	Method whereby interest is calculated based on the actual number of business days in the interest period divided by 252. Usage: Brazilian Currency Swaps. Method equal to BUS/252 in the FpML model and BusTwoFiftyTwo in the FIX/FIXML model.	12	BUS/252	Used for Brazilian real swaps, which is based on business days instead of calendar days. The number of business days divided by 252. [Symbolic name: BusTwoFiftyTwo]	BUS/252	The number of Business Days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 252.
A019	Actual360NL	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period, excluding any leap day from the count, and a 360-day year.	16	NL360	This is the same as Act/360, with the exception of leap days (29 February) which are ignored. [Symbolic name: NLThreeSixty]		
A020	1/1	If parties specify the Day Count Fraction to be 1/1 then in calculating the applicable amount, 1 is simply input into the calculation as the relevant Day Count Fraction. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a).	0	1/1	If parties specify the Day Count Fraction to be 1/1 then in calculating the applicable amount, 1 is simply input into the calculation as the relevant Day Count Fraction. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a). [Symbolic name: OneOne]	1/1	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a).

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ⁷⁷	FIX/FIXML ⁷⁸ code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ⁷⁹ code	FpML definition
NARR	Narrative	Other method.			Other FIX/FIXML code values not listed above and FIX/FIXML code values that are reserved for user extensions, in the range of integer values of 100 and higher.		

3.3 Valuation method

Classification of valuation inputs

Bucket	Input used	Valuation method ⁸¹
1	Quoted prices in active markets for identical assets or liabilities that the entity can access at the measurement date [IFRS 13:76/ASC 820-10-35-40]. A quoted market price in an active market provides the most reliable evidence of fair value and is used without adjustment to measure fair value whenever available, with limited exceptions. [IFRS 13:77/ASC 820-10-35-41] An active market is a market in which transactions for the asset or liability take place with sufficient frequency and volume to provide pricing information on an ongoing basis. [IFRS 13: Appendix A/ASC 820-10-20].	Mark-to-market
2	Quoted prices for similar assets or liabilities in active markets [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-47] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly)	Mark-to-market
3	Quoted prices for identical or similar assets or liabilities in markets that are not active [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(b)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly).	Mark-to-model – historic prices from inactive markets should not be directly used
4	Inputs other than quoted prices that are observable for the asset or liability, for example interest rates and yield curves observable at commonly quoted intervals, implied volatilities, credit spreads [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(c)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly)	Mark-to-market
5	Inputs that are derived principally from or corroborated by observable market data by correlation or other means ("market-corroborated inputs") [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(d)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly).	Mark-to-model – the inputs can be derived "principally" from observable market data, meaning that unobservable inputs can be used
6	Unobservable inputs for the asset or liability. [IFRS 13:86/ASC 820-10-35-52] Unobservable inputs are used to measure fair value to the extent that relevant observable inputs are not available, thereby allowing for situations in which there is little, if any, market activity for the asset or liability at the measurement date. An entity develops unobservable inputs using the best information available in the circumstances, which might include the entity's own data, taking into account all information about market participant assumptions that is reasonably available. [IFRS 13:87-89/ASC 820-10-35-53 - 35-54A]	Mark-to-model – unobservable inputs are used

⁸¹ The classification provided in this column is independent from IFRS 13/ASC 820 and is for the sole purpose of reporting critical data elements of OTC derivative transactions.

3.4 Collateralisation category

Value	Name	Definition
UNCL	Uncollateralised	There is no collateral agreement between the counterparties or the collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that no collateral (neither initial margin nor variation margin) has to be posted with respect to the derivative transaction.
PRC1	Partially collateralised: Counterparty 1 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty regularly posts only variation margin and that the other counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
PRC2	Partially collateralised: Counterparty 2 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty regularly posts only variation margin and that the reporting counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
PRCL	Partially collateralised	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that both counterparties regularly post only variation margin with respect to the derivative transaction.
OWC1	One-way collateralised: Counterparty 1 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the other counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
OWC2	One-way collateralised: Counterparty 2 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the reporting counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
OWP1	One-way/partially collateralised: Counterparty 1	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the other counterparty regularly posts only variation margin.
OWP2	One-way/partially collateralised: Counterparty 2	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the reporting counterparty regularly posts only variation margin.
FLCL	Fully collateralised	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that both counterparties post initial margin and regularly post variation margin with respect to the derivative transaction.

3.5 Action and event reporting

The below table specifies the allowable combinations of [Action type] and [Event type]. It also sets out whether they apply at transaction level, position level or both. The last column of the table indicates when a given [Action type] can be reported without [Event type].

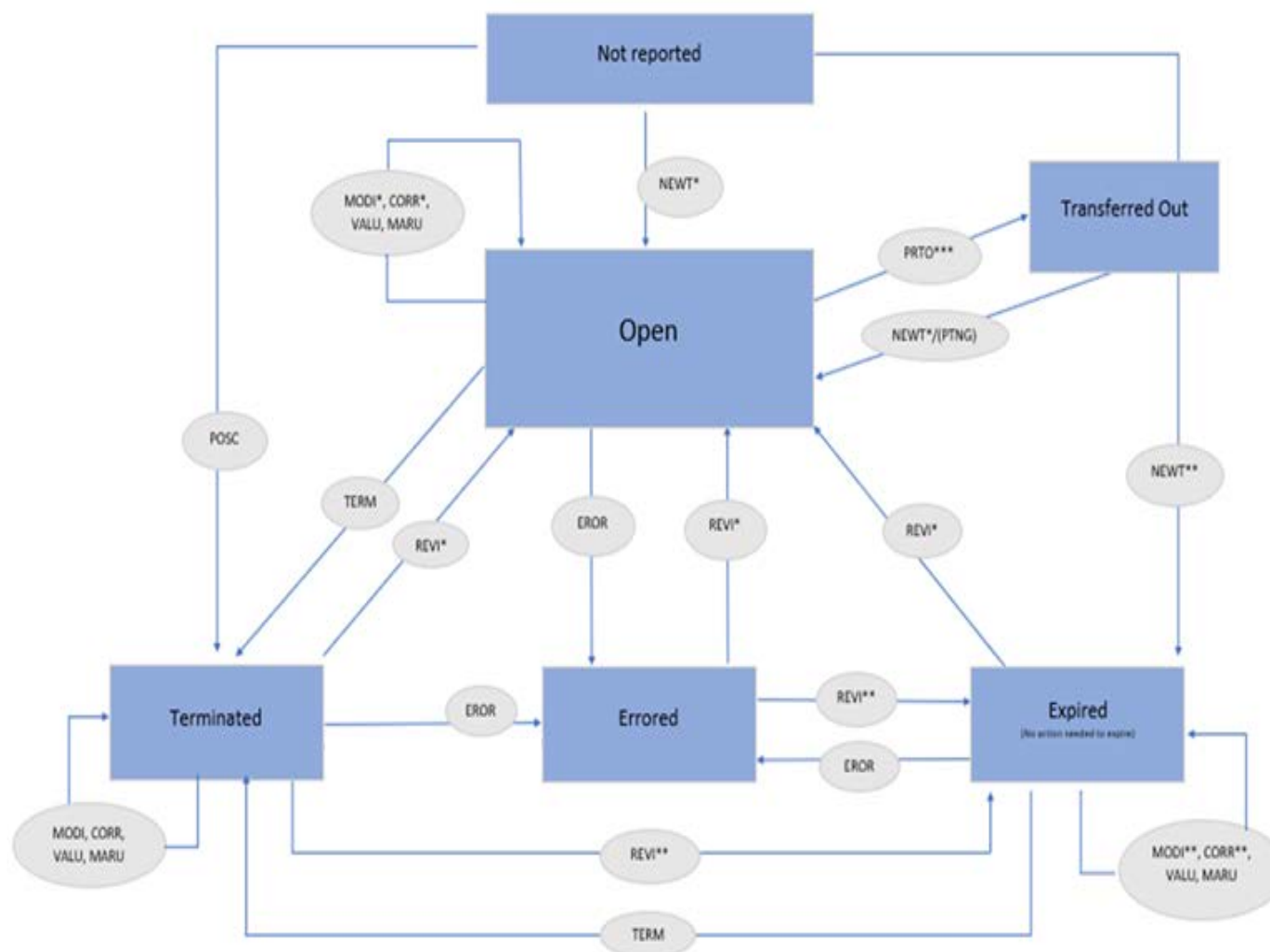
Event Type

Action
Type

Action type & Event type combinations	Trade (TRAD)	Novation (NOVA)	Compression or Risk Reduction Exercise (COMP)	Early Termination (ETRM)	Clearing (CLRG)	Exercise (EXER)	Allocation (ALOC)	Clearing & Allocation (CLAL)	Credit Event (CREV)	Transfer (PTNG)	Corporate Event (CORP)	Upgrade (UPDT)	Inclusion In Position (INCP)	No Event Type Required
New (NEWT)	T	T,P	T		T	T	T	T		T,P	T,P	T ⁸²	P	
Modify (MODI)	T,P	T,P	T	P		T	T		T		T,P	T,P	P	P
Correct (CORR)														T,P
Terminate (TERM)		T,P	T	T,P	T	T	T	T	T		T,P		T,P ⁸³	
Error (EROR)														T,P
Revive (REVI)														T,P
Transfer out (PRTO) ⁸⁴										T,P				
Valuation (VALU)														T,P
Collateral (MARU)														T,P
Position component(POSC)														T

⁸² NEWT-UPDT is used for upgrading existing 'exotic', 'complex', or 'non-standard' swaps to accurately report and comply with the Technical Manual⁸³ If a derivative is traded and immediately added to a position, it must be reported using the action type 'POSC'. However, if a derivative is reported as a new transaction ('NEWT') but then later added into a position, it should be reported using the action type 'TERM' and event type 'INCP'.⁸⁴ Any live or dead (terminated or expired) transactions can be transferred out except for the transactions that are previously reported as an error. Once a transaction is reported as 'transfer out' to a trade repository no further submission is allowed to the same trade repository for that transaction unless the transaction is transferred back in to the same trade repository. Combination 'NEWT-PTNG' should be used in this case.

3.6 Allowable Action Type Sequences



Reporting is facilitated by combinations of action type and event type. The action type sequence is designed to avoid illogical submissions by reporting counterparties. A submission with an action type that is not possible based on the previous action type should not satisfy the trade repository's validation procedure.

Notes: The status of the derivative after revival; depends on the maturity date:

* with Expiration Date $\geq$ today

** with Expiration Date < today

*** PRTO is also accepted (but not expected) for termination or expired

3.7 Definitions for Event Type Allowable Values

Event type	Allowable value	Definition
Trade	TRAD	Creation or modification of a transaction.
Novation/Step-in	NOVA	A novation or step-in legally moves part or all of the financial risks of a transaction from a transferor to a transferee and has the effect of terminating/modifying the original transaction so that it is either terminated or its notional is modified.
Post trade risk reduction exercise	COMP	Compressions and other post trade risk reduction exercises generally have the effect either of terminating or modifying (i.e., reducing the notional value) a set of existing transactions and/or of creating a set of new transaction(s). These processes result in largely the same exposure of market risk that existed prior to the event for the counterparty.
Early termination	ETRM	Termination of an existing transaction prior to expiration date.
Clearing	CLRG	Central clearing is a process where a central counterparty (CCP) interposes itself between counterparties to transactions, becoming the buyer to every seller and the seller to every buyer and thereby ensuring the performance of open transactions. It has the effect of terminating an existing transaction between the buyer and the seller.
Exercise	EXER	The full or partial exercise of an option or swaption by one counterparty of the transaction.
Allocation	ALOC	The process by which portions of a single transaction are allocated to one or multiple different counterparties and reported as new transactions. ⁸⁵
Clearing & Allocation	CLAL	A simultaneous clearing and allocation event in a central counterparty (CCP).
Credit event	CREV	An event that results in a modification or a termination of a previously submitted credit transaction. Applies only to credit derivatives.
Transfer	PTNG	The process by which a transaction is transferred to another trade repository that has the effect of the closing of the transaction at one trade repository and opening of the same transaction using the same UTI in a different trade repository (new).
Inclusion in position	INCP	Inclusion of a CCP-cleared transaction or other fungible transactions into a position, where an existing transaction is terminated and either a new position is created or the notional of an existing position is modified.
Corporate event	CORP	The process by which a corporate action is taken on equity underlying that impacts the transactions on that equity.
Update	UPDT	Update of an outstanding transaction performed in order to ensure its conformity with the amended reporting requirements.

⁸⁵ Where a derivative is entered into by an agent of a counterparty and the transaction is executed before the derivative is allocated among the counterparties on whose behalf the agent is acting, we would prefer for the reporting counterparty not to report derivatives data in respect of the pre-allocation transaction and instead, once it receives and processes the allocation from the agent, to report only the allocated derivatives within the time periods set out in section 31 of the TR Rules. However, we would accommodate reporting in respect of the pre-allocation transaction as set out in this Technical Manual, and for that reason we have provided ALOC as an allowable value. Please also see Example 4.4.

Event type	Allowable value	Definition

3.8 Definitions for Action Type Allowable Values

Action type	Allowable value	Definition
New	NEWT	The creation of the first transaction resulting in the generation of a new UTI.
Modify	MODI	A modification of the terms of a previously reported transaction due to a newly negotiated modification (amendment) or a filling in of not available missing information (e.g., post price transaction). It does not include correction of a previously reported transaction.
Correct	CORR	A correction of erroneous data of a previously reported transaction.
Terminate	TERM	A termination of a previously reported transaction.
Error	EROR	A cancellation of a wrongly submitted entire transaction in case it never came into existence or was not subject to the reporting requirements under the applicable law of a given jurisdiction, or a cancellation of a duplicate report.
Revive	REVI	An action that reinstates a reported transaction that was reported with action type "Error" or terminated by mistake or expired due to an incorrectly reported Expiration date.
Valuation	VALU	An update of a valuation of a transaction. There will be no corresponding Event type.
Collateral/Margin update	MARU	An update to collateral margin data. There will be no corresponding Event type.
Position component	POSC	A report of a new transaction that is included in a separate position report on the same day.
Transfer out	PRTO	A transfer of a transaction from one trade repository to another trade repository (change of trade repository).

3.9 Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other)

For an 'Underlier ID' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier IDs, please follow below guidance for the allowable values set out below. Note this is not exhaustive, and other types may be included.

Asset Class	Underlier ID Type	Form of Underlier ID if not in golden source
Interest Rate	Floating Rate Index	ISDA FRO Name
	Debt Security Identifier	If no ISIN, then official registered name of the issuer—Maturity Date—Type of interest—Interest Rate—Interest Frequency—Debt Seniority
	Debt Index Identifier	Publisher's official long name of the index
	Inflation Index	ISDA FRO Name
Equity	Equity Index Name	Publisher's official long name of the index
	Equity Stock Identifier	If no ISIN (e.g. an unlisted stock), then official registered name of the stock—CFI 2 nd character—CFI 3 rd character
	Equity Index Identifier	Publisher's official long name of the index
Credit	Debt Security Identifier	If no ISIN, then official registered name of the issuer—Maturity Date—Type of interest—Interest Rate—Interest Frequency—Debt Seniority
	Debt Index Identifier	Publisher's official long name of the index
	Non-LEI entity identifier	Legal entity name as would be recorded in an LEI record
Commodity	Commodity Index	Publisher's official long name of the index
	Commodity Reference Price	ISDA CRP Name
Other	Exchange-traded future	If no ISIN, then MIC & Venue Product Code & F & F & YYYY-MM-DD & 0
	Exchange-traded option	If no ISIN, then MIC & Venue Product Code & O & P/C & YYYY-MM-DD & option strike price
	Digital Asset	ISO 24165 Digital Token Identifier

3.10 Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other) source

For an 'Underlier ID source' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier ID source, please follow below guidance for the allowable values set out below. Note this is not exhaustive, and other types may be included.

Asset Class	Underlier ID Type	Form of Underlier ID source
Interest Rate	Floating Rate Index	ISDA FRO Naming Convention
	Debt Security Identifier	CDE debt name and type
	Debt Index Identifier	Publisher's legal name
	Inflation Index	ISDA FRO Naming Convention
Equity	Equity Index Name	Publisher's legal name
	Equity Stock Identifier	CDE equity name and type
	Equity Index Identifier	Publisher's legal name
Credit	Debt Security Identifier	CDE debt name and type
	Debt Index Identifier	Publisher's legal name
	Non-LEI entity identifier	Entity name
Commodity	Commodity Index	Publisher's legal name
	Commodity Reference Price	ISDA CRP Naming Convention
Other	Exchange-traded future	All
	Exchange-traded option	All
	Digital Asset	ISO 24165 Digital Token Identifier

4 Examples

4.1 SEF Transactions – Anonymous and cleared

This example illustrates the reporting of anonymous transactions that are subsequently cleared.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI	Notional amount	Execution timestamp	Clearing receipt timestamp	Submitter identifier	Central counterparty	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2	Cleared	Platform identifier
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	NULL	LEI1SEF0001	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
2	TERM	CLRG	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
3	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001BETA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI2CP0002	Y	NULL
4	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001GAMMA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1RPT0001	Y	NULL

4.2 Package- Price/Spread

This example illustrates how to report package transactions based on either the price or spread.

Row 1 – Submission of a new package transaction but the package transaction price is not known yet.

Row 2 – Modifying the package transaction to update the package transaction price.

Row 3 – Submission of a new package transaction with a package transaction spread.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Package Indicator	Package identifier	Package transaction price	Package transaction price currency	Package transaction price notation	Package transaction spread	Package transaction spread currency	Package transaction spread notation	Price	Price currency	Notional amount		Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001EEE	True	ABCD12	99999.999999999999	NULL	1	NULL	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	2023-04-05T16:14:36Z	LEI1RPT0001EEE	True	ABCD12	3.2	CAD	1	NULL	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	True	ABCD34	NULL	NULL	NULL	200	NULL	4	20.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	

4.3 Partial Termination/Amendment, Correction

This example illustrates how different Action – Event type combinations are used to report changes to a previously submitted transaction.

Row	Action type	Event type	Amendment indicator	Event timestamp	Expiration date	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Embedded option type	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	True	2023-04-02T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	MODI	TRAD	False	2023-04-03T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		OPET	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
4	CORR			2023-04-04T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		EXTD	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.4 Allocation

This example illustrates how pre- and post- "Allocation" transactions are reported.

Row	Action type	Event type	Amendment indicator	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
2	TERM	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
3	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST1	LEI1RPT0001PREAA	4000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A1
4	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST2	LEI1RPT0001PREAA	6000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A2

4.5 Position

This example illustrates how a derivative is reported when it is included in a position.

Row 1,2- Submitting new derivative that is the start of a new position on the same day (buy activity).

Row 3 - Submitting end of day valuation messages at position level.

Row 4,5,6 – Submitting new derivative that is included in a position on the same day (buy and sell activity).

Row 7,8,9,10,11 – Submitting new derivative (alternative way of reporting trade) that is included in a position on the next day (buy activity) (which means VALU messages will need to be sent for both LEIRPT0001TRAD3 and LEIRPT0001POSC1 on Jan 8 2023)

Row 12 – Since LEIRPT0001TRAD3 have been included into Position LEIRPT0001POSC1 on Jan 9 2023, only VALU message for the Position LEIRPT0001POSC1 need to be sent.

Row 13 - Submitting sell activity to be included in Position LEIRPT0001POSC1.

Row 14 - Submitting early termination at position level due to sell activity.

Row 15 - Submitting end of day valuation messages at position level.

Row 16 – Submitting sell activity to be included in Position LEIRPT0001POSC1.

Row 17 – Termination of the position.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	UTI	Subsequent position UTI	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1	Counterparty 2	Level	Buyer identifier	Seller identifier	Valuation Amount	Price ⁸⁶
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	NEWT	INCP	2023-01-05T14:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
3	VALU		2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	1.68	
4	POSC		2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		13
5	POSC		2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001TRAD8	LEIRPT0001POSC1	100	2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13
6	MODI		2023-01-07T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.333
7	NEWT	TRAD	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		14
8	VALU		2023-01-08T18:01:34Z	LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	23	
9	VALU		2023-01-08T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	65	
10	TERM	INCP	2023-01-09T18:02:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		14
11	MODI	INCP	2023-01-09T18:02:34Z	LEIRPT0001POSC1		2,200	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
12	VALU		2023-01-09T18:03:34Z	LEIRPT0001POSC1		2,200	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	71.02	
13	POSC		2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001TRAD4	LEIRPT0001POSC1	1,200	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.50
14	MODI	ETRM	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
15	VALU		2023-01-10T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	78	
16	POSC		2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001TRAD5	LEIRPT0001POSC1	1,000	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.75
17	TERM	ETRM	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

4.5a Position – intraday

This example illustrates intraday trades where the net position at the end of the day is 0.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	UTI	Subsequent position UTI	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1	Counterparty 2	Level	Buyer identifier	Seller identifier	Valuation Amount	Price ⁸⁷
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	POSC		2023-01-05T10:45:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	400	2023-01-05T10:45:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12.44
3	POSC		2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		12.58
4	NEWT	INCP	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		0
5	TERM	ETRM	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

⁸⁶ The price values in this example are for illustrative purposes and will vary depending on the calculation methodology used.

⁸⁷ The price values in this example are for illustrative purposes and will vary depending on the calculation methodology used.

4.6 Error and Revive

This example illustrates a derivative that was booked in error and subsequently cancelled, but needs to be revived as it was cancelled by mistake.

Row	Action type	Event type	Amendment Indicator	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	EROR			2023-04-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	REVI			2023-04-05T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.7 Crypto

Row	Action type	Event type	Crypto asset underlying indicator – Leg 1	Crypto asset underlying indicator – Leg 2	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Unique product identifier	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD	True	False	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG	QZ8VLPDHMT5	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.8 Upgrade

This example illustrates how to report an upgrade event type in order to ensure its conformity with the amended reporting requirements.

Row 1: A new derivative executed on 2023-04-01.

Row 2: New reporting requirements were implemented, the existing derivative is reported as Modify-Upgrade (MODI-UPDT) in order to comply with the new requirements.⁸⁸

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Notional amount	Valuation Method	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2	Platform Identifier	Cleared
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MarkToMarket	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	NULL	N
2	MODI	UPDT	2024-05-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MTMA	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	BILT	N

⁸⁸ Please note that the example provided is not an exhaustive list of the fields affected by the amended reporting requirements. Therefore, it is recommended that you review the rule to identify all fields that may be impacted.

Annex B

Not applicable in Québec

Annex C

CSA Derivatives Data Technical Manual

Technical specifications for over-the-counter derivatives data reporting

~~July 25~~ August 11, 2024 ~~2026~~

Version ~~1.0~~ 2.0

Document History

Revisions

<u>Date</u>	<u>Version</u>	<u>Description</u>
<u>7/25/2024</u>	<u>1.0</u>	<u>First publication along with amendments to the TR Rules.</u>
<u>8/11/2026</u>	<u>2.0</u>	<u>Second publication with revisions</u>

Table of Contents

1	INTRODUCTION	<u>45</u>
1.1	Background	<u>45</u>
1.1.1	Format of technical specifications	<u>45</u>
1.2	Explanation of Certain Data Elements or Categories	<u>67</u>
1.2.1	Direction of the transaction	<u>67</u>
1.2.2	Repeating data elements or leg-based products	<u>67</u>
1.2.3	Schedules	<u>67</u>
1.2.4	Actions and Events	<u>68</u>
1.2.5	Validations	<u>68</u>
1.2.6	Unique Product Identifier	<u>7</u> <u>Underlier ID (Other) fields</u>
	<u>9</u>	
1.2.7	Other payment fields	<u>79</u>
1.2.8	Packages	<u>89</u>
1.2.9	Position reporting	<u>810</u>
1.2.10	Prior UTI	<u>810</u>
1.3	Historical Derivatives	<u>910</u>
2	TECHNICAL SPECIFICATIONS	<u>1011</u>
2.1	Position reporting guidelines	<u>5256</u>
3	APPENDIX	<u>5661</u>
3.1	Notional amount	<u>5661</u>
3.2	Mapping of Day count convention allowable values to ISO 20022, FpML, and FIX/FIXML values	<u>5762</u>
3.3	Valuation method	<u>6570</u>
3.4	Collateralisation category	<u>6671</u>
3.5	Action and event reporting	<u>6671</u>

3.6	Allowable Action Type Sequences	68 <u>73</u>
3.7	Definitions for Event Type Allowable Values	69 <u>74</u>
3.8	Definitions for Action Type Allowable Values	70 <u>75</u>
<u>3.9</u>	<u>Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other)</u>	<u>76</u>
<u>3.10</u>	<u>Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other) source</u>	<u>77</u>
4	EXAMPLES	71 <u>78</u>
4.1	SEF Transactions – Anonymous and cleared	71 <u>78</u>
4.2	Package- Price/Spread	71 <u>78</u>
4.3	Partial Termination/Amendment, Correction	72 <u>79</u>
4.4	Allocation	72 <u>79</u>
4.5	Position	72 <u>79</u>
	<u>4.5a Position – intraday</u>	<u>80</u>
4.6	Error and Revive	73 <u>81</u>
4.7	Crypto	74 <u>82</u>
4.8	Upgrade	74 <u>82</u>

1 Introduction

1.1 Background

The technical specifications in this CSA Derivatives Data Technical Manual (the **Technical Manual**) specify the definition, format, and allowable values for each data element that is required to be reported under Manitoba Securities Commission Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting*, Ontario Securities Commission Rule 91-507 *Derivatives: Trade Reporting, Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting* (Québec) and, in the remaining provinces and territories, Multilateral Instrument 96-101 *Derivatives: Trade Reporting* (collectively, the **TR Rules**) and are sourced primarily from the *Revised CDE Technical Guidance - version 34: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)*¹ (the **CDE Technical Guidance**).

The Technical Manual is intended to assist market participants in reporting under amendments to the TR Rules that ~~are expected to become effective~~ came into effect on July 25, 2025.

All terms in the Technical Manual that are defined in a TR Rule have the same meaning as in the applicable TR Rule, unless otherwise provided in the Technical Manual or unless the context otherwise requires.

Where data elements align with the data elements prescribed by the Commodity Futures Trading Commission (the **CFTC**), the Technical Manual has generally adopted the name, definition, format, and allowable values as set out by the CFTC.

It is expected that the Technical Manual will be updated on a periodic basis to reflect updates from the Canadian Securities Administrators (**CSA**) and international updates.

1.1.1 Format of technical specifications

- (1) **#:** all data elements are assigned a number for ease of reference. The data element number is referenced throughout the Technical Manual and in Appendix A to each of the TR Rules.
- (2) **Source:** this column contains "CDE", "CSA", "CFTC" or "ESMA". "CDE" refers to a data element in the CDE Technical Guidance. "CFTC" refers to a data element sourced from the Commodities Futures Trading Commission. "ESMA" refers to a data element sourced from the European Securities and Markets Authority.
- (3) **Category:** data elements are grouped by topic or category.
- (4) **Data Element Description:** a concise description of the data element that is set out in Appendix A to each of the TR Rules and reproduced in the Technical Manual for convenience. These descriptions are intended to comply with CSA rule drafting standards while substantively aligning with the corresponding detailed explanation.
- (5) **Detailed Explanation of Data Element:** for CDE data elements, the explanation is sourced from the CDE Technical Guidance, with footnotes added to provide clarity based on the CFTC's regulations. For CFTC data elements, the explanation is sourced from the CFTC Technical Specification, with footnotes added to provide clarity. For ESMA data elements, the explanation is sourced from EMIR REFIT validation rules. Data elements sourced from the CFTC and ESMA apply regardless of reporting requirements in the U.S. or Europe. For example, data elements sourced from the CFTC apply to all derivatives that are required to be reported under the TR Rules, as applicable, and not only to swaps under CFTC rules. Further, they apply under the TR Rules regardless of whether the derivative is otherwise required to be reported under CFTC rules.
- (6) **Format:** see Table below that illustrates the meaning of formats used throughout the document.

¹ See Revised CDE Technical Guidance – version 34 – Harmonisation of critical OTC derivative data elements (other than UTI and UPI), September 2023, https://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20230929.pdf December 2025, https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf

Format	Content in brief	Additional Explanation	Example(s)
YYYY-MM-DD	Date	YYYY = four-digit year MM = two-digit month DD = two-digit day	2015-07-06 (corresponds to 6 July 2015)
YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Date and time	YYYY, MM, DD as above hh = two-digit hour (00 through 23) (am/pm NOT allowed) mm = two-digit minute (00 through 59) ss = two-digit second (00 through 59) T is fixed and indicates the beginning of the time element. Z is fixed and indicates that times are expressed in UTC (Coordinated Universal Time) and not in local time.	2014-11-05T13:15:30Z (corresponds to 5 November 2014, 1:15:30 pm, Coordinated Universal time, or 5 November 2014, 8:15:30 am US Eastern Standard Time)
Num(25,5)	Up to 25 numerical characters including up to five decimal places	The length is not fixed but limited to 25 numerical characters including up to five numerical characters after the decimal point. Should the value have more than five digits after the decimal, reporting counterparties should round half-up.	1352.67 12345678901234567890.12345 1234567890123456789012345 0 - 20000.25 - 0.257
Num(5) ²	Up to five numerical characters, no decimals are allowed	The length is not fixed but limited to five numerical characters	12345 123 20
Char(3)	Three alphanumeric characters	The length is fixed at three alphanumeric characters.	USD X1X 999
Varchar(25)	Up to 25 alphanumeric characters	The length is not fixed but limited at up to 25 alphanumeric characters. No special characters are permitted. If permitted, it would be explicitly stated in the format of the data element.	asgaGEH3268EFdsagtTRCF543 aaaaaaaaa x
Boolean	Boolean characters	Either "True" or "False" or "true" or "false" ³	True / true False / false

Table 1 – Explanation of formats used in the Technical Specification

² Num(5) format is equivalent to Num(5,0) used in this Technical Manual and does not allow decimals.³ Both upper case and lower case are allowed until the ISO 20022 message standard is adopted by CSA.

1.2 Explanation of Certain Data Elements or Categories

1.2.1 Direction of the transaction

The Technical Manual requires the reporting of Buyer/Seller or Payer/Receiver for this data element. This is a slightly different approach from that taken in the CDE Technical Guidance, which provides two options for reporting Direction. The reporting counterparty should not report both Buyer/Seller and Payer/Receiver for a given transaction, but instead use the reporting method appropriate for the type of instrument reported.

1.2.2 Repeating data elements or leg-based products

Depending on the product being reported and the related market convention, a multi-leg or multi-stream product could be reported using a particular data element more than once. Unless the data element is listed as "leg", it cannot be reported more than once. For products where the multi-leg or multi-stream concept is not applicable, report values in the designated data element for the first leg (Leg 1) for all fields that are specified as leg-based data elements. For products having two legs where one leg references a fixed value and the other leg references a floating value, Leg 1 elements should refer to the leg that references a fixed value and Leg 2 elements should refer to the leg that references a floating value. For products having two legs where each leg references a floating value respectively, the legs should be ordered based on the alphabetical ordering of the names of the respective underliers. In cases where the names of the respective underliers are the same, but they are differentiated by a tenor, Leg 1 elements should refer to the leg referencing the underlier with the shorter tenor.

1.2.3 Schedules

Derivatives involving schedules ~~which specify the details known at the time of execution of the transaction~~ are required to be reported as part of creation data if the details are known at the time of execution, or as part of a lifecycle event when the scheduled values become known during the life of the transaction. Fields that require reporting of multiple values in a single field can be reported using a delimiter between the reported values. The choice of delimiter is left to the discretion of the trade repository ~~but the delimiter usage must be the same in all files. Fields that allow multiple values for submission have a standard variable length of 500 characters as the data type regardless;~~ however, the same delimiter must be used consistently across all files. The format and allowable values listed in Table 2 apply to each individual value within a scheduled field, rather than the delimited field. Each entry must independently meet the format and validation rules applicable to the data element.

~~of how each trade repository is collecting from their participants~~ When schedule fields are populated, they must contain the same number of entries across all related fields, and the entries must be ordered chronologically by effective date. Public dissemination is required for the first 10 values in schedule fields.

The following data elements permit the reporting of multiple values:

- [10 Jurisdiction of Counterparty 1](#)
- [11 Jurisdiction of Counterparty 2](#)
- [37 Notional quantity schedule - effective date](#)
- [38 Notional quantity schedule - end date](#)
- [39 Notional quantity schedule - notional quantity](#)
- [40 Notional amount schedule - notional amount](#)
- [41 Notional amount schedule - effective date](#)
- [42 Notional amount schedule - end date](#)
- [50 Price schedule – effective date](#)
- [51 Price schedule – end date](#)
- [52 Price schedule – price](#)
- [65 Strike price schedule – effective date](#)
- [66 Strike price schedule – end date](#)
- [67 Strike price schedule – strike price](#)
- [77 Clearing exceptions and exemptions - Counterparty 1](#)
- [78 Clearing exceptions and exemptions – Counterparty 2](#)
- [124 Basket constituent identifier](#)
- [125 Basket constituent identifier source](#)
- [126 Basket constituent number of units](#)
- [127 Basket constituent unit of measure](#)
- [136 Other payment amount](#)
- [137 Other payment currency](#)
- [138 Other payment date](#)
- [139 Other payment payer](#)
- [140 Other payment receiver](#)
- [141 Other payment type](#)

1.2.4 Actions and Events

Appendix 3.5 illustrates how different events should be reported in transaction reporting, position reporting and end-of-day (valuation and collateral) reporting.

At a minimum, any data elements that are impacted as part of actions and events should be reported. It is at the trade repository's discretion whether other elements should be included for event message types.

Corrections of valuation and collateral are allowed and should be reported using "VALU" and "MARU" action types.

1.2.5 Validations

Validations are generally intended to be the same as the CFTC's as specified in its Part 45 swap data reporting requirements when the Technical Manual data element is also required by the CFTC. A trade repository may limit the number of data elements required to be submitted for Action Type TERM, PRTO, and EROR.

Reporting Types:

Transaction = Creation data and Lifecycle Event data: Transaction means entering into, assigning, selling or otherwise acquiring or disposing of a derivative or the novation of a derivative. Each transaction must be reported as a unique derivative under the TR Rules.

Valuation= Valuation Data: Valuation data means data that reflects the current value of the derivative and includes the data in the elements listed in Appendix A under the heading "Data Elements Related to Valuation".

Collateral = Margin Data: Collateral and margin data means data that reflects the current amount of collateral and margin posted or collected as described in the elements listed in Appendix A under the heading "Data Elements Related to Collateral and Margin".

Values:

M=Mandatory (The data element is mandatory and any additional validation rules, if specified, must also be followed)

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.]

C= Conditional (The data element is required if the conditions set out in the validation rules are fulfilled. Additional validation rules, if specified, must also be followed)

NR= Not Required (The data element is not required to be included in the report)

O= Optional (The data element should be ~~included in the transaction reported~~ **if applicable to the derivative**. Additional validation rules, if specified, may be applied when populated)

Example:

"Transaction - C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank}" means

Transaction - C (Conditional):

This field is **M (Mandatory)** if both [Payer identifier] and [Receiver identifier] are **not populated**. Otherwise, leave it **blank**.

"Transaction - C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {optional}" means

Transaction - C (Conditional):

This field is **M (Mandatory)** if both [Payer identifier] and [Receiver identifier] are **not populated**. Otherwise, the field is **O (Optional)** (i.e., it may be included if applicable to the derivative).

Leg-based data elements:

~~Validations in the Technical Manual included for leg-based data elements are meant~~ If a data element is leg-based and Table 2 does not provide leg-specific validations, the validations are intended to apply to the first leg (Leg 1) by default. However, it should not be presumed that the same validations apply ~~similarly~~ to the second leg (Leg 2). This is largely due to the conditionality between leg fields, and the fact that trade repository specific data elements ~~can alter the application of~~ may affect how published validations operate in ways not contemplated in the Technical Manual. Given this, trade repositories may incorporate ~~other~~ additional validations for ~~leg-level~~ leg-level data elements, ~~should where~~ they deem it necessary.

1.2.6 Underlier ID (Other) fields

~~A value may be provided where there is an else {blank}. It may be interpreted as "else optional".~~

~~1.2.6 Unique Product Identifier~~

Data elements related to underlying asset:

This set of data elements captures information related to underliers when the information cannot be derived from the UPI. These data elements apply to all asset classes and should support any underliers.

- Data elements 128 and 129 should be ~~used~~ reported when the UPI ~~Service Provider~~ service provider does not ~~receive~~ support the identifier and its source for a particular underlier. ~~In these cases, values for~~ When not supported, both 'Underlier ID' and 'Underlier ID source' ~~are submitted~~, or their equivalent attributes, are assigned the value as 'OTHER' ~~to be either the submitter or~~ the UPI service provider. Below is some guidance for allowable values to use.

o **Underlier IDs not in Golden Source:** For an 'Underlier ID' or 'Underlier ID Source' not present in the golden source, which serves as the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier IDs, refer to Table 9 and Table 10 in the Annex for predefined allowable values, which are not exhaustive, and other types may be included.

o **Underlier ID in Golden source but not yet in UPI enumeration list:** For an 'Underlier ID' that exists in the golden source but is not yet included in the UPI service provider's enumeration

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.]

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

list (i.e. due to a lag between the creation of a new 'Underlier ID' in the golden source and its addition to the enumeration list), the allowable value should be the value as it exists in the golden source.

- Data elements 130 and 131 are necessary to determine the price of an underlier asset or index that cannot be derived from the given UPI.
- Data element 121 is necessary to easily identify the derivative transactions based on crypto assets that cannot be identified from the given UPI.

1.2.7 Other payment fields

The set of data elements related to other payments can be reported multiple times in the case of multiple payments. If other payments are made in instalments, the entire schedule of payments is reported.

1.2.8 Packages

Package identifier should be used by reporting counterparties or entities responsible for reporting as a unique link between reports belonging to the same derivative contract, where the table of fields does not enable submitting the details in only one report and where the package transaction is composed of a combination of derivative contracts that are negotiated together as the product of a single economic agreement.

If a derivative contract ceases to exist, but gives rise to another derivative, those two contracts should be considered individually and not be reported as a package transaction, thus no package identifier should be used to link those reports in such circumstance, while at the same time the field 'Prior UTI' should be reported.

The reporting field 'Package transaction price' and 'Package transaction price currency' should be populated with the relevant price and currency for the entire package transaction rather than the price and currency of the individual components. If the individual components have individual prices and currencies, those should be populated in the relevant report in field 'Price' and 'Price currency' in addition to the population of the field 'Package transaction price'.

1.2.9 Position reporting

Position reporting is an optional method of reporting for derivatives that meet the requirements under section 33.1 of the TR Rules. The "Position Reporting guidelines" in section 2.1 sets out how to report lifecycle events in relation to certain data elements. Lifecycle events may be reported at the position level in respect of all relevant data elements where derivatives meet these conditions. Refer to example 4.5 to review how positions are to be reported.

Positions may not be reported without previously reporting the derivatives separately at transaction level. Derivatives at transaction level should be updated to have an appropriate status, so that it is clear that they are no longer open and to avoid double-counting of the derivatives that were included in positions. The reporting counterparty should report the terminations of all the derivatives at transaction level that enter into the position. For new derivatives that are included in the position on the same day, action type "POSC" with no event type should be used. For derivatives that are included in the position on all other days, action type "TERM" and event type "INCP" should be used.

Where a position valuation becomes zero, there are only two possible ways to proceed:

- Termination of the position and reporting of a new one using a different UTI at a later stage. No valuations are reported between the termination of the first position and the creation of the latter.
- Maintaining the position open and reporting a zero contract value on a daily basis.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

1.2.10 Prior UTI

Prior UTI should be assigned to the predecessor derivative that has given rise to the reported derivative due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between derivatives. This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between derivatives (e.g., in the case of a compression). In particular, the prior UTI will be applicable in the following events:

- a. Full or partial novation (reported with Action Type: NEWT and Event Type: NOVA and includes Prior UTI);
- b. Clearing;
- c. Exercise (in the case of swaptions);
- d. Allocation (reported with Action Type: NEWT and Event Type: ALOC and includes Prior UTI);

~~e. Corporate event (in the case of a split).~~

1.3 Historical Derivatives

Counterparties should not create a new UTI for outstanding derivatives, even if the original UTI is not fully compliant with e.g., new format requirements under the Technical Manual. For existing derivatives that utilize a USI (Unique Swap Identifier), the trade repository can allow for these to be submitted in a separate data element.

All existing derivatives should eventually be updated with the new data requirements and reported using the action field Modify (MODI) and event type Upgrade (UPDT).

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

2 Technical Specifications

Data Elements Related to Counterparties

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
1	CDE	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Identifier of the reporting counterparty.	Identifier of the counterparty to an OTC derivative transaction⁴ who is fulfilling its reporting obligation via the report in question. In jurisdictions where both parties must report the transaction, the identifier of Counterparty 1 always identifies the reporting counterparty. In the case of an allocated derivative transaction executed by a fund manager on behalf of a fund, the fund and not the fund manager is reported as the counterparty. However, if the allocation of the block trade to specific funds does not take place prior to the reporting deadline, then the fund manager executing the transaction on behalf of the fund can be reported as the counterparty. If a trading facility is fulfilling the reporting obligation, the identifier of Counterparty 1 identifies one of the counterparties to the transaction.	Char(20) for an LEI code	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/).	N	Transaction- M Collateral -M Valuation -M
2	CDE	Counterparty 2 (non-reporting counterparty)	Identifier of the non-reporting counterparty.	Identifier of the second counterparty⁵ to an OTC derivative transaction. In the case of an allocated derivative transaction executed by a fund manager on behalf of a fund, the fund and not the fund manager is reported as the counterparty. However, if the allocation of the block trade to specific funds does not take place prior to the reporting deadline, then the fund manager executing the transaction on behalf of the fund can be reported as the counterparty.	- Char(20) for an LEI code or - Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or - Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	- ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). - For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. - An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- M Collateral -M Valuation -M

⁴ References to “OTC derivative” and “transaction” in CDE data element explanations and in the Appendices to the Technical Manual should be read to mean derivative.

⁵ Only one counterparty should be reported. In cases where multiple counterparties are legally responsible as the second counterparty (for example joint and several liability, or solidary liability in Quebec), report only one of the counterparties and use the same counterparty for all continuation data and lifecycle events.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
3	CFITC DE	Counterparty 2 identifier source	Type of Counterparty 2 identifier.	Source used to identify the Counterparty 2.	Char(4)	• LEID = Legal Entity Identifier • NPID = Natural Person Identifier, to identify person <u>persons</u> who are acting as private individuals- (not business entities <u>eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity</u>). • PLID = An internal identifier only if (1) Counterparty 2 is subject to a blocking law or consent requirement, (2) the applicable CSA regulatory authority has issued a relief decision to the reporting counterparty relating to blocking laws and consent requirements, and (3) the reporting counterparty is complying with the conditions of the relief decision.	N	Transaction- M Collateral - M Valuation - M
4	CDE	Buyer identifier	Identifier of the counterparty that is the buyer.	Identifier of the counterparty that is the buyer, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank} 2 When populated: 2 2 the value shall match the value in <u>either</u> [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2] 2 the value shall not match the value in [Seller identifier]. Collateral- NR Valuation- NR
5	CDE	Seller identifier	Identifier of the counterparty that is the seller.	Identifier of the counterparty that is the seller, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction- C if [Payer identifier] and [Receiver identifier] are not populated, else {blank} 2 When populated: 2 2 the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2] 2 the value shall not match the value in [Buyer identifier]. Collateral- NR Valuation- NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
6	CDE	Payer identifier [Payer identifier–Leg 1] [Payer identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the payer leg.	Identifier of the counterparty of the payer leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps⁶, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such reporting requirements.	N	Transaction- C if [Buyer identifier] and [Seller identifier] are not populated, else {blank}⁷. When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2]. Collateral- NR Valuation- NR
7	CDE	Receiver identifier [Receiver identifier-Leg 1] [Receiver identifier-Leg 2]	Identifier of the counterparty of the receiver leg.	Identifier of the counterparty of the receiver leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps⁷, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). • For natural persons who are acting as private individuals (not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. • An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such reporting requirements.	N	Transaction- C if [Buyer identifier] and [Seller identifier] are not populated, else {blank}⁷. When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] or [Counterparty 2]. Collateral- NR Valuation- NR
8	ESMA	Broker identifier ⁸	Identifier of a broker that acts as an intermediary for Counterparty 1 without becoming a counterparty.	In the case a broker acts as intermediary for the counterparty 1 without becoming a counterparty itself, the counterparty 1 shall identify this broker by legal entity identifier.	Char(20)	• ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/)	N	Transaction- O Collateral- NR Valuation- NR

⁶For fixed floating interest rate swaps, the payer is the counterparty paying the fixed rate.

⁷For fixed floating interest rate swaps, the receiver is the counterparty receiving the fixed rate.

⁸The ESMA Data Element Name is “Broker ID”.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
9	CSA	Country and Province or Territory of Individual (non-reporting counterparty)	If an individual is a non-reporting counterparty, the individual's country of residence and, if the individual's residence is in Canada, the province or territory.	If the non-reporting counterparty is an individual, the individual's country of residence and, if the individual's residence is in Canada, the province or territory.	CharVarchar(5)	Any valid value based on ISO 3166-2 <u>if the individual's residence is in Canada; otherwise, use ISO 3166 for the individual's country of residence.</u>	N	Transaction - Q Transaction - C if [Counterparty 2 identifier source] = 'NPID', else (optional) Collateral - NR Valuation - NR
10	CSA	Jurisdiction of Counterparty 1	Each jurisdiction in which Counterparty 1 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, if the non-reporting counterparty is an individual who is a resident of the jurisdiction, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).⁹²	Each jurisdiction in which Counterparty 1 is: - a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, if the non-reporting counterparty is an individual who is a resident of the jurisdiction, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).⁹²	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	N	Transaction – M Collateral – NR M Valuation – NR M
11	CSA	Jurisdiction of Counterparty 2	Each jurisdiction in which Counterparty 2 is: a local counterparty under paragraph (a) or	Each jurisdiction in which Counterparty 2 is:	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	To be determined by the designated/recognized trade repository in coordination with the CSA.	N	Transaction – M Collateral – NR M Valuation – NR M

⁹² A list of qualified persons is available here: <https://lautorite.qc.ca/en/professionals/securities-and-derivatives/regulation-of-derivatives-markets-in-quebec>

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
			(c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, and/or a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).	- a local counterparty under paragraph (a) or (c) of the definition of local counterparty in the derivatives data reporting rules of any jurisdiction of Canada, and/or - a local counterparty under paragraph (b) of the definition of local counterparty in <i>Regulation 91-507 respecting Trade Repositories and Derivatives Data Reporting</i> (Québec) and is a qualified person under section 82 of the <i>Derivatives Act</i> (Québec).				

Data Elements Related to Derivatives

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
12	CDE	Effective date ¹⁰⁸	Unadjusted date at which obligations under the derivative come into effect, as provided in the confirmation.	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction come into effect, as included in the confirmation. <u>A non-exhaustive list of examples is:</u> <u>For credit default swaps on a credit index, effective date should be the effective date of the contract (which is usually one or two days following the execution date), not the roll date of the underlying index.</u> <u>For FRAs, effective date should be the effective date of the contract, not the settlement date.</u> <u>For options & swaptions, effective date should be the effective date of the contract, not the underlier.</u> <u>For IRS forward starting swaps, effective date should be the effective date of the contract, which is called the forward start date in the contract.</u>	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- M Collateral- NR Valuation- NR

¹⁰⁸ For commodities swaps, report the pricing start date.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				For contracts without an effective date included in the confirmation, if reported, effective date which starts immediately should be the date part of Execution timestamp. For new contracts stemming from lifecycle events, effective date should be the effective date of the new contract.				
13	CDE	Expiration date ¹³⁹	Unadjusted date at which obligations under the derivative cease to be effective, as provided in the confirmation.	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction stop being effective, as included in the confirmation. Early termination does not affect this data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- C if UPI.[ReturnorPayoutTrigger] is not 'Contract for Difference (CFD)' else (blank optional). When populated, the value shall be equal to or later than the value in [Effective date] or the date portion of [Execution Timestamp] Collateral- NR Valuation- NR
14	CDE	Execution timestamp	Date and time of execution of a transaction.	Date and time a transaction was originally executed, resulting in the generation of a new UTI. This data element remains unchanged throughout the life of the UTI. ¹⁴⁰	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC. ¹⁴¹ If the time element is not required in a particular jurisdiction, time may be dropped given that – in the case of representations with reduced accuracy – ISO 8601 allows the complete representation to be omitted, the omission starting from the extreme right-hand side (in the order from the least to the most significant).	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction- M Collateral- NR Valuation- NR
15	CDE	Reporting timestamp ¹⁴²	Date and time of submission of the report to the trade repository.	Date and time of the submission of the report as reported to the trade repository.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction- M, the value shall be equal to or later than the value in [Execution timestamp] Collateral- M Valuation- M

¹³⁹ For commodities swaps, report the pricing end date.

¹⁴⁰ For cleared derivatives, the execution timestamp is the date and time when the clearing agency accepts the original derivative for clearing.

¹⁴¹ Both the date and time portion are required to be reported.

¹⁴² Reporting timestamp (#15) is recorded and reported by the submitter.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
16	CDE	Unique transaction identifier (UTI)	Unique identifier that identifies a derivative or position throughout its lifecycle.	A unique identifier assigned at the transaction or position level which identifies them uniquely throughout their lifecycle and used for all recordkeeping and reporting.	Varchar(52)	ISO 23897 Unique transaction identifier, up to 52 alphanumeric characters. New UTIs should be constructed solely from the upper-case alphabetic characters A–Z or the digits 0–9, inclusive in both cases. UTI is comprised of the LEI of the generating entity and a unique alphanumeric code.	N	Transaction- M Collateral- C if [Initial margin collateral portfolio code] = 'TRANSACTION-LEVEL', else {blank} Valuation- M
17	CDE	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	UTI assigned to a derivative before the occurrence of a lifecycle event that resulted in the current derivative.	UTI assigned to the predecessor transaction that has given rise to the reported transaction due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between transactions (e.g., in the case of a novation, when a transaction is terminated, and a new transaction is generated) or in a one-to-many relation between transactions (e.g., in clearing or if a transaction is split into several different transactions). This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between transactions (e.g., in the case of a compression).	Varchar(52)	ISO 23897 Unique transaction identifier, up to 52 alphanumeric characters. New UTIs should be constructed solely from the upper-case alphabetic characters A–Z or the digits 0–9, inclusive in both cases.	N	Transaction- C if [Action type] = 'NEW' and ([Event type] = 'NOVAT' or 'CLRG' or 'EXER' or 'ALOC' or 'CLAL') and [Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)] is not populated, else {blank optional} Collateral- NR Valuation- NR
18	ESMA	Subsequent position UTI	UTI of the position in which a derivative is included.	The UTI of the position in which a derivative is included. This field is applicable only for the reports related to the termination of a derivative due to its inclusion in a position.	Up to 52 alphanumeric characters, only the upper-case alphabetic characters A–Z and the digits 0–9 are allowed	Upper-case alphabetic characters A–Z and digits 0–9 allowed	N	Transaction – C if ([Action type] = 'POSC') or ([Action type] = 'TERM' and [Event type] = 'INCP'), else {blank} Collateral – NR Valuation - NR
19	CFTC	Prior USI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Unique swap identifier (USI) assigned to a derivative before the occurrence of a lifecycle event that resulted in the current derivative.	Unique swap identifier (USI) assigned to the predecessor transaction that has given rise to the reported transaction due to a lifecycle event, in a one-to-one relation between transactions (e.g., in the case of a novation, when a transaction is terminated, and a new transaction is generated) or in a one-to-many relation between transactions (e.g., in clearing or if a transaction is split into several different transactions). This data element is not applicable when reporting many-to-one and many-to-many relations between transactions (e.g., in the case of a compression).	Varchar(42)	Refer to: CFTC USI Data Standard Up to 42 alphanumeric characters	N	Transaction- C if [Action type] = 'NEW' and ([Event type] = 'NOVAT' or 'CLRG' or 'EXER' or 'ALOC' or 'CLAL') and [Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)] is not populated, else {blank optional} Collateral- NR Valuation- NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
20	CSA	Inter-affiliate indicator	Indicator of whether the derivative is between two affiliated entities.	Indicate whether the derivative is between two affiliated entities.	Boolean	• TRUETrue = contract entered into as an inter-affiliate transaction • FALSEFalse = contract not entered into as an inter-affiliate transaction	N	Transaction – M Transaction – C if [Platform anonymous execution indicator] = 'False' and [Cleared] = 'N', else (optional) Collateral – NR Valuation - NR
21	CFTC DE	Submitter identifier	Identifier of the entity submitting derivatives data to the trade repository.	Identifier of the entity submitting the OTC derivative transaction to the Trade Repository. Identifier of the entity submitting the data to the swap data repository.¹⁵ The submitter identifier will be the same as the reporting counterparty or swap execution facility (SEF).¹⁶ unless they use a third-party service provider to submit the data to SDR in which case, report the identifier of the third-party service provider. If a third-party service provider is used to submit the data to the Trade Repository, report the identifier of the third-party service provider.	Char(20)	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org www.gleif.org).	N	Transaction- M Collateral - M Valuation -M
22	CDE	Platform identifier	Identifier of the trading facility on which the transaction was executed.	Identifier of the trading facility (e.g., exchange, multilateral trading facility, swap execution facility) on which the transaction was executed.	Char(4)	ISO 10383 Segment Market Identifier Code. ^{17,18} If no trading facility was involved in the transaction: • XOFF, for transactions in listed instruments • XXXX, for transactions in instruments that are not listed in any venue • BILT, if the reporting counterparty cannot determine whether the instrument is listed or not, as per jurisdictional requirements.	Y	Transaction- C if [Cleared] = 'N' or 'I'; NR if [Cleared] = 'Y', else (optional) Collateral- NR Valuation- NR
23	CSA	Platform anonymous execution indicator	Indicator of whether the transaction was executed anonymously on a trading facility.	Indicator of whether the transaction was executed anonymously on a trading facility.	Boolean	• True = transaction was executed anonymously on a platform • False = transaction was not executed anonymously on a platform or not applicable	N	Transaction – M ¹⁴ Collateral – NR Valuation - NR

¹⁵ References to “swap data repository” or “SDR” in CFTC data element explanations should be read to mean designated / recognized trade repository.

¹⁶ References to “swap execution facility” or “SEF” in CFTC data element explanations should be read to mean derivatives trading facility / facility or platform for trading derivatives.

^{17,18} Where the Segment MIC does not exist, use the Operating MIC.

¹⁴ Data element 23 is mandatory for transactions executed on a trading facility.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
24	ESMA	Master agreement type	Type of master agreement.	Reference to the master agreement type under which the counterparties concluded a derivative.	Char(4)	• 'ISDA' - ISDA • 'CDEA' - FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement • 'EUMA' - European Master Agreement • 'FPCA' - FIA Professional Client Agreement • 'FMAT' - FBF Master Agreement relating to transactions on forward financial instruments • 'DERV' - Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) • 'CMOP' - Contrato Marco de Operaciones Financieras • 'CHMA' - Swiss Master Agreement • 'IDMA' - Islamic Derivative Master Agreement • 'EFMA' - EFET Master Agreement • 'GMRA' - GMRA • 'GMSL' - GMSLA • 'BIAG' - bilateral agreement • Or 'OTHR' if the master agreement type for cleared swaps and for any other derivative transaction that is not covered by a Master Agreement type, or where the relevant Master Agreement is not included in the above preceding list.	N	Transaction – M Transaction – C if [Platform anonymous execution indicator] = 'False', else (optional) Collateral – NR Valuation – NR
25	ESMA	Master agreement version	Year of the master agreement version.	Reference to the year of the master agreement (e.g. 1992, 2002) relevant to the reported derivative, if applicable.	YYYY	ISO 8601 Date in the format YYYY	N	Transaction – C if [Master agreement type] is populated with a value different from 'BIAG' or 'OTHR'; this field shall be populated: or null, else (optional) Collateral – NR Valuation – NR

Data Elements Related to Notional Amounts and Quantities

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
26	CDE	Notional amount ^{146 15} [Notional amount-Leg 1] [Notional amount-Leg 2]	Notional amount for each leg of a derivative: • if the derivative is negotiated in a monetary amount, the amount specified in the derivative. • if the derivative is negotiated in a non-monetary amount, convert to a monetary amount.	For each leg of the transaction, where applicable: - for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts, the amount specified in the contract. - for OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts, refer to Appendix 3.1 for converting notional amounts for non-monetary amounts. • For OTC derivative transactions with a notional amount schedule, the initial notional amount, agreed by the counterparties at the inception of the transaction, is reported in this data element. • For OTC foreign exchange options, in addition to this data element, the amounts are reported using the data elements Call amount and Put amount. • For amendments or lifecycle events ^{146 16} , the resulting outstanding notional amount is reported; (steps in notional amount schedules are not considered to be amendments or lifecycle events); • Where the notional amount is not known when a new transaction is reported, the notional amount is updated as it becomes available.	Num(25,5)	Any value (Negative values are only allowed for commodity derivatives when applies, e.g. to account for the cost of storage.) ¹⁴⁷	Y	Transaction-FX-M: if UPI.[Instrument-type]= 'Option', the value shall match the value in [Call amount] or [Put amount] Transaction- CR/FX/CO/EQ -M Collateral- NR Valuation- NR
27	CDE	Notional currency [Notional currency-Leg 1] [Notional currency-Leg 2]	For each leg of a derivative, the currency of the notional amount.	For each leg of the transaction, where applicable: currency in which the notional amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	Y	Transaction-M: if UPI.[Instrument-type]= 'Option', the value shall match the value in [Call currency] or [Put currency] Collateral-NR Transaction - [Notional currency - Leg 1] C if [Notional amount - Leg 1] is populated, else (blank) [Notional currency - Leg 2] C if [Notional amount - Leg 2] is populated, else (blank) Collateral - NR Valuation - NR

^{146 15} Notional amount for CDS should reflect the gross amount and not the net amount after reflecting version incrementing due to a credit event.

^{146 16} In the case of a lifecycle event that is a full termination before the maturity date, the full terminated value should be reported in the notional data element.

¹⁴⁷ "99999999999999999999.99999" is accepted when the value is not available. 25 numerical characters including decimals.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
28	CDE	Call amount	Monetary amount that a person or company has the right to buy under an option.	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to buy.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction – FX C if UPL.[Instrument type] = 'Option' and UPL.[Product] ≠ <u>Digital Option</u> , at least one is required: ([Call amount] or [Put amount]), <u>else (optional)</u> Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation NR
29	CDE	Call currency	Currency of the call amount of an option.	For foreign exchange options, the currency in which the Call amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction – FX C if [Call amount] is populated, else {blank} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR
30	CDE	Put amount	Monetary amount that a person or company has the right to sell under an option.	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to sell.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - FX C if UPL.[Instrument type] = 'Option' and UPL.[Product] ≠ <u>Digital Option</u> , at least one is required: ([Call amount] or [Put amount]), <u>else (optional)</u> Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR
31	CDE	Put currency	Currency of the put amount of an option.	For foreign exchange options, the currency in which the Put amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction – FX C if [Put amount] is populated, else {blank} Transaction – CR/EQ/IR/CO – NR Collateral - NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
32	CFTC	Notional quantity [Notional quantity-Leg 1] [Notional quantity-Leg 2]	For each leg of a derivative negotiated in a non-monetary amount, the fixed notional quantity for each schedule period.	For each leg of the swap transaction ²¹⁻¹⁸ where applicable, for swap transactions negotiated in non-monetary amounts, the fixed notional quantity for each schedule period (i.e., 50 barrels per month). The frequency is reported in Quantity frequency and the unit of measure is reported in Quantity unit of measure.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction – CO O When populated, the value shall be equal to or less than the value in [Total notional quantity]. Transaction – IR/FX/CR/EQ – NR Collateral - NR Valuation - NR
33	CFTC	Quantity frequency ²²⁻¹⁹ [Quantity frequency-Leg 1] [Quantity frequency-Leg 2]	Period for which the quantity is quoted.	For each leg of the swap transaction where applicable, the rate at which the quantity is quoted on the transaction. e.g., hourly, daily, weekly, monthly.	Char(4)	• HOUL = Hourly • DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • ONDE = OnDemand • YEAR = Yearly • EXPI = End of term • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular	N	Transaction - CO [Quantity frequency – Leg 1] C if [Notional quantity – Leg 1] is populated, else {blank} [Quantity frequency – Leg 2] C if [Notional quantity – Leg 2] is populated, else {blank} Transaction – IR/FX/CR/EQ - NR Collateral - NR Valuation - NR
34	CFTC	Quantity frequency multiplier [Quantity frequency multiplier-Leg 1] [Quantity frequency multiplier-Leg 2]	Number of periods of the quantity frequency.	For each leg of the swap transaction where applicable, the number of time units for the Quantity frequency.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - CO [Quantity frequency multiplier – Leg 1] C if [Quantity frequency – Leg 1] ≠ 'ONDE' or 'ADHO', else {blank optional} [Quantity frequency multiplier – Leg 2] C if [Quantity frequency – Leg 2] ≠ 'ONDE' or 'ADHO', else {optional} Transaction – IR/FX/CR/EQ - NR

²¹⁻¹⁸ References to “swap” and “swap transaction” in CFTC data element explanations should be read as derivative.

²²⁻¹⁹ To represent quarterly, report [Quantity frequency] = 'MNTH' and [Quantity frequency multiplier] = '3'. For semi-annual, report [Quantity frequency] = 'MNTH' and [Quantity frequency multiplier] = '6'.

²³/₂₀"999999999999999999.99999" is accepted when the value is not available. 25 numerical characters including decimals.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
		[End date of the notional quantity-Leg 1] [End date of the notional quantity -Leg 2]	convention) of the notional quantity.	The initial notional quantity and associated unadjusted effective and end date are to be <u>Unadjusted end date of the notional quantity (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period)</u> <u>The initial notional quantity schedule - end date is</u> reported as the first <u>valuesvalue</u> of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional quantities that are condition- or event-dependent. The quantity unit of measure for the varying notional quantities in the schedule is reported in Quantity unit of measure.				associated effective date is populated, else (blank) <u>Transaction – CO O</u> <u>The number of date values must equal the number of notional quantity values if populated.</u> <u>Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR</u> Collateral – NR Valuation - NR
39	CDE	Notional quantity schedule - Notional quantity in effect on associated effective date [Notional quantity in effect on associated effective date-Leg 1] [Notional quantity in effect on associated effective date-Leg 2]	Each notional quantity, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 37 to the date referred to in Data Element Number 38.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts with a Notional quantity schedule: Notional quantity which becomes effective on the associated unadjusted effective date. The initial notional quantity and associated unadjusted effective and end date are to be <u>schedule – notional quantity is</u> reported as the first <u>valuesvalue</u> of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional quantities that are condition- or event-dependent. The quantity unit of measure for the varying notional quantities in the schedule is reported in Quantity unit of measure.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction – CO O <u>The number of notional quantity values must equal the number of date intervals.</u> Transaction – CR/IR/FX/EQ – NR Collateral - NR Valuation - NR
40	CDE	Notional amount schedule - notional amount in effect on associated effective date [Notional amount in effect on associated effective date-Leg 1] [Notional amount in effect on associated effective date-Leg 2]	Each notional amount, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 41 to the date referred to in Data Element Number 42.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: Notional amount which becomes effective on the associated unadjusted effective date. The initial notional amount and associated unadjusted effective and end date are to be <u>schedule – notional amount is</u> reported as the first <u>valuesvalue</u> of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.	Num(25,5)	Any value based on ISO 20022: Derivative/Notional/CurrencyAndAmount	N	Transaction - IR C if UPI.[Notional schedule] ≠ 'Constant', else (blank optional) The number of notional amount values must equal the number of start and end date intervals. Transaction – CR/FX/CO/EQ - O Collateral - NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
41	CDE	Notional amount schedule - unadjusted effective date of the notional amount [Effective date of the notional amount-Leg 1] [Effective date of the notional amount-Leg 2]	For each notional amount set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the notional amount becomes effective.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: • Unadjusted date on which the associated notional amount becomes effective The initial notional amount schedule – effective date is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Notional amount schedule - notional amount in effect on associated effective date] is populated, else {blank} The number of date values must equal the number of notional amount values. Collateral - NR Valuation - NR
42	CDE	Notional amount schedule - unadjusted end date of the notional amount [End date of the notional amount-Leg 1] [End date of the notional amount-Leg 2]	For each notional amount set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the notional amount.	For each leg of the transaction, where applicable for applicable for OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts with a notional amount schedule: • Unadjusted end date of the notional amount (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period). The initial notional amount schedule - end date is reported as the first value of the schedule. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with notional amounts that are condition- or event-dependent. The currency of the varying notional amounts in the schedule is reported in Notional currency.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Notional amount schedule - notional amount in effect on associated effective date] is populated, else {blank} - O The number of date values must equal the number of notional amount values if populated . Collateral - NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Elements Related to Prices

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
43	CDE	Exchange rate ²⁴¹	Exchange rate between 2 different currencies specified in the derivative.	Exchange rate between the two different currencies specified in the OTC derivative transaction agreed by the counterparties at the inception of the transaction, expressed as the rate of exchange from converting the unit currency into the quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency; USD 1 = EUR 0.9426. Forward exchange rate should be reported.	Num(18,13)	Any value greater than zero.	N	Transaction – FX – M C if UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {optional} Transaction – IR/CR/CO/EQ - NR Collateral – NR Valuation – NR
44	CDE	Exchange rate basis [Exchange rate basis-Leg 1] [Exchange rate basis-Leg 2]	Currency pair and order in which the exchange rate is denominated.	Currency pair and order in which the exchange rate is denominated, expressed as unit currency/quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency, USD 1 = EUR 0.9426.	Char(3)/Char(3); [Unit currency/Quoted currency], without restricting the currency pair ordering (i.e., the exchange rate basis may be USD/EUR or EUR/USD.	Any pair of currencies included in ISO 4217.	N	Transaction – FX – M Transaction – IR/CR/CO/EQ - NR Collateral – NR Valuation – NR
45	CDE	Fixed rate [Fixed rate-Leg 1] [Fixed rate-Leg 2]	For each leg of a derivative with periodic payments, the annual rate of the fixed leg.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments, per annum rate of the fixed leg(s).	Num(11,10)	Positive and negative values expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%)	Y	Transaction – CR C if [Spread] is not populated and [Other payment type] ≠ 'UFRO', and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional} Transaction - IR C if [Spread] is not populated [and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional}] Transaction - CO C if [Price] or [Spread] is not populated and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional} Transaction – FX/EQ - NR Q Collateral - NR Valuation - NR

²⁴¹ For FX, forward exchange rate would be reported in this data element.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
46	CDE	Price ²⁵²²	Price specified in the derivative.	Price specified in the OTC derivative transaction. It does not include fees, taxes or commissions. For commodity fixed/float swaps and similar products²⁶²³ with periodic payments, this data element refers to the fixed price of the fixed leg(s). For commodity and equity forwards and similar products, this data element refers to the forward price of the underlying or reference asset. For equity swaps, portfolios swaps, and similar products, this data element refers to the initial price of the underlying or reference asset. For contracts for difference and similar products, this data element refers to the initial price of the underlier. This data element is not applicable to: • Interest rate swaps and forward rate agreements, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate and Spread may be interpreted as the price of the transaction. • Interest rate options and interest rate swaptions as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Commodity basis swaps as it is understood that the information included in the data element Spread may be interpreted as the price of the transaction. • Foreign exchange swaps, forwards and options, as it is understood that the information included in the data elements Exchange rate, Strike price, and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Equity options as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. • Credit default swaps and credit total return swaps, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate, Spread and Upfront payment (Other payment type: Upfront payment) may be interpreted as the price of the transaction. • Commodity options, as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. Where the price is not known when a new transaction is reported, the price is updated as it becomes available.	• Num(18,13), if Price notation = 1 • Num(11,10), if Price notation = 3	• Any value, if Price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Price notation = 3	Y	Transaction - EQ C if [Spread] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else (blankoptional) Transaction - CO C if ([Fixed rate] or [Spread] is not populated), and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else (blankoptional) Transaction – IR/FX/CR - NRQ Collateral – NR Valuation - NR

²⁵²² While Price (#46) captures the prices at which counterparties negotiate contracts, market prices are reflected in the valuation amounts.

²⁶²³ References to “product” in CDE data element explanations should be read to mean derivative.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				For transactions that are part of a package, this data element contains the price of the component transaction where applicable.				
47	CDE	Price currency	Currency in which the price is denominated.	Currency in which the price is denominated. Price currency is only applicable if Price notation = 1.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction - EQ/CO -C if [Price notation] = '1', else {blank} Collateral - NR Transaction - IR/FX/CR - NR Collateral - NR Valuation - NR
48	CDE	Price notation	Manner in which the price is expressed.	Manner in which the price is expressed.	Char(1)	1 = Monetary amount 3 = Decimal	Y	Transaction - EQ/CO -C if [Price] is populated, else {blank} Transaction - IR/FX/CR - NR Collateral - NR Valuation - NR
49	CDE	Price unit of measure	Unit of measure in which the price is expressed.	Unit of measure in which the price is expressed.	Char <u>Varchar</u> (4)	ISO 20022: UnitOfMeasureCode codeset or other TR approved UOM codeset	N	Transaction - EQ/CO -C if [Price] is populated, else {blank} Transaction - IR/FX/CR - NR Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
50	CDE	Price schedule - unadjusted effective date of the price	For each price set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the price becomes effective.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted effective date of the price. Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	YYYY-MM-DD, based on UTC	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - EQ/CO-C if [Price schedule - price] is populated, else {blank} The number of date values must equal the number of price values. Transaction - CR/IR/FX - NR Collateral - NR Valuation - NR
51	CDE	Price schedule - unadjusted end date of the price	For each price set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the price.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted end date of the price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period). Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - EQ/CO-C if [Price schedule - price] is populated, else {blank} Transaction - CR/IR/FX - NR Transaction - O The number of date values must equal the number of price values if populated. Collateral - NR Valuation - NR
52	CDE	Price schedule - price	Each price, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 50 to the date referred to in Data Element Number 51.	For OTC derivative transactions with prices varying throughout the life of the transaction: • Price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Price schedule is only applicable if the price varies per schedule. The currency, notation, and unit of measure for the varying prices in the schedule are reported in Price currency, Price notation, and Price unit of measure data elements.	• Num(18,13), if Price notation = 1 • Num(11,10), if Price notation = 3	• Any value greater than zero, if Price notation = 1 • Any value expressed as decimal (eg 0.0257 instead of 2.57%), if Price notation = 3	N	Transaction - EQ C if [Price] or [Spread] is not populated, and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else { blank optional } Transaction - CO C if ([Price], [Fixed rate], or [Spread] is not populated) and UPI.[Instrument type] ≠ 'Option', else { blank optional } The number of price values must equal the number of start date intervals.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Transaction – CR/IR/FX – NR Collateral - NR Valuation - NR
53	CDE	Spread ²⁷²⁴ [Spread-Leg 1] [Spread-Leg 2]	For each leg of a derivative, the specified spread on the reference price.	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments (e.g., interest rate fixed/float swaps, interest rate basis swaps, commodity swaps), • spread on the individual floating leg(s) index reference price, in the case where there is a spread on a floating leg(s). For example, USD-LIBOR-BBA plus .03 or WTI minus USD 14.65; or • difference between the reference prices of the two floating leg indexes. For example, the 9.00 USD “Spread” for a WCS vs. WTI basis swap where WCS is priced at 43 USD and WTI is priced at 52 USD.	• Num(18,13), if Spread notation = 1 • Num(11,10), if Spread notation = 3 • Num(5), if Spread notation = 4	• Any value, if Spread notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Spread notation = 3 • Any integer value expressed in basis points (e.g., 257 instead of 2.57%), if Spread notation = 4	Y	Transaction - CR C if [Fixed rate] is not populated and [Other payment type] ≠ 'Upfront payment UFRO', and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional } Transaction - IR C if [Fixed rate] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional } Transaction - EQ C if [Price] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional } Transaction – CO C if [Price] or [Fixed rate] is not populated, and UPL[Instrument type] ≠ 'Option', else {blank optional } Transaction – FX - NR Collateral – NR Valuation – NR
54	CDE	Spread currency [Spread currency-Leg 1] [Spread currency-Leg 2]	For each leg of a derivative, the currency in which a spread is denominated.	For each leg of the transaction, where applicable: the currency in which the spread is denominated. This data element is only applicable if Spread notation = 1.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction – CR/IR/EQ/CO [Spread currency – Leg 1] C if [Spread notation – Leg 1] = '1', else {blank} Transaction – FX – NR

²⁷²⁴ For equity swaps, portfolio swaps, and contract for difference (CFDs), report the weighted overall spread for the basket instead of individual legs.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								[Spread currency – Leg 2] C if [Spread notation – Leg 2] = '1', else (blank) Collateral – NR Valuation – NR
55	CDE	Spread notation [Spread-LegSpread notation - Leg 1] [Spread-LegSpread notation - Leg 2]	For each leg of a derivative, the manner in which a spread is expressed.	For each leg of the transaction, where applicable: the manner in which the spread is expressed.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal • 4 = Basis points	Y	Transaction – Transaction – CR/IR/EQ/CO [Spread notation – Leg 1] C if [Spread – Leg 1] is populated, else (blank) [Spread notation – Leg 2] C if [Spread – Leg 2] is populated, else (blank) Transaction – FX – NR Collateral – NR Valuation – NR
56	CDE	Strike price	For a derivative that is an option, the price at which the owner of the option can buy or sell the underlying interest of the option.	• For options other than FX ²⁸ options, swaptions and similar products, the price at which the owner of an option can buy or sell the underlying asset of the option. • For FX options, the exchange rate at which the option can be exercised, expressed as the rate of exchange from converting the unit currency into the quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency; USD 1 = EUR 0.9426. Where the strike price is not known when a new transaction is reported, the strike price is updated as it becomes available. • For volatility and variance swaps and similar products, the volatility / variance strike price.	• Num(18,13), if Strike price notation = 1 • Num(11,10), if Strike price notation = 3	• Any value (e.g., USD 6.39 ²⁹ expressed as 6.39 ²⁹), for equity options, commodity options, foreign exchange options and similar products, if Strike price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.021 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 3	Y	Transaction - C if UPL [Instrument type] = 'Option', else (blank ^{optional}) Collateral - NR Valuation - NR
57	CDE	Strike price currency/currency pair	Currency, or the currency pair and order, in which the strike price is denominated.	For equity options, commodity options, and similar products, the currency in which the strike price is denominated. For foreign exchange options: the currency pair and order in which the strike price is expressed. The strike price is expressed as unit currency/quoted currency. In the example 0.9426 USD/EUR, USD is the unit currency and EUR is the quoted currency, USD 1 = EUR 0.9426 Strike price currency/currency pair is only applicable if Strike price notation = 1.	• Char(3) • For foreign exchange options: Char(3)/Char(3); [Unit currency/Quoted currency] without restricting the currency pair ordering (i.e., the Strike price currency pair may be USD/EUR or EUR/USD).	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - C if [Strike price notation] = '1', else (blank ^{optional}) Collateral - NR Valuation - NR

²⁸ References to “FX” in CDE data element explanations should be read to mean foreign exchange.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
58	CDE	Strike price notation	Manner in which the strike price is expressed.	Manner in which the strike price is expressed.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal	Y	Transaction - C if [Strike price] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
59	CDE	Unadjusted effective date of the price	Effective date (unadjusted for business day convention) of the price.	Unadjusted effective date of the price [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	YYYY-MM-DD, based on UTC [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]	N	Transaction - C if [Price schedule - Price in effect between the unadjusted effective date and end date] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 50]
60	CDE	Unadjusted end date of the price	End date (unadjusted for business day convention) of the price.	Unadjusted end date of the price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period) [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	YYYY-MM-DD, based on UTC [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]	N	Transaction - C if [Price schedule - Price in effect between the unadjusted effective date and end date] is populated, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 51]
61	CDE	Price in effect between the unadjusted effective and end dates	Price in effect from the date referred to in Data Element Number 59 to the date referred to in Data Element Number 60.	Price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Price schedule is only applicable if the price varies per schedule [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	• Num(18,13), if Price notation = 1 • Num(11,10), if Price notation = 3 [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	• Any value greater than zero, if Price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g. 0.0257 instead of 2.57%), if Price notation = 3 [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]	N	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 52]
62	CDE	Effective date of the strike price	Effective date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	Unadjusted effective date of the strike price [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	YYYY-MM-DD, based on UTC [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format [Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]	N	Transaction - C if [Strike price schedule - strike price in effect on associated effective date] is populated, else {blank} Collateral - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Valuation – NR[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 65]
63	CDE	End date of the strike price	End date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	Unadjusted end date of the strike price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period).[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	YYYY-MM-DD, based on UTC.[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]	N	Transaction – C if [Strike price schedule – strike price in effect on associated effective date] is populated, else {blank} Collateral – NR Valuation – NR[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 66]
64	CDE	Strike price in effect on associated effective date	Strike price in effect from the date referred to in Data Element Number 62 to the date referred to in Data Element Number 63.	Strike price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule.[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	• Num(18,13), if Strike price notation = 1 • Num(11,10), if Strike price notation = 2 • Num(11,10) if Strike price notation = 3[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	Any value greater than zero: • Any value (e.g. USD 6.39) expressed as 6.39, for equity options, commodity options, foreign exchange options and similar products if Strike price notation = 1. • Any value expressed as percentage (e.g. 2.1 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 2. • Any value expressed as decimal (e.g. 0.021 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 3.[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]	N	Transaction – O Collateral – NR Valuation – NR[Not Applicable: Duplicate of Data Element # 67]
65	CDE	Strike price schedule – Unadjusted effective date of the strike price	For each strike price set out in a schedule, the date (unadjusted for business day convention) on which the strike price becomes effective.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted effective date of the strike price. Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Strike price schedule - strike price] is populated, else {blank} <u>The number of date values must equal the number of strike price values.</u> Collateral - NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
66	CDE	Strike price schedule – Unadjusted end date of the strike price	For each strike price set out in a schedule, the end date (unadjusted for business day convention) of the strike price.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: • Unadjusted end date of the strike price (not applicable if the unadjusted end date of a given schedule's period is back-to-back with the unadjusted effective date of the subsequent period). Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - O Transaction C if (Strike price schedule - The number of date values must equal the number of strike price) is values if populated, else (blank). Collateral - NR Valuation - NR
67	CDE	Strike price schedule - strike price	Each strike price, as set out in a schedule, in effect from the date referred to in Data Element Number 65 to the date referred to in Data Element Number 66.	For options, swaptions and similar products with strike prices varying throughout the life of the transaction: • Strike price in effect between the unadjusted effective date and unadjusted end date inclusive. Strike price schedule is only applicable if the strike price varies per schedule. The currency for the varying strike prices in the schedule is reported in Strike price currency data element.	• Num(18,13), if Strike price notation = 1 • Num(11,10), if Strike price notation = 3	• Any value (e.g. USD 6.39) expressed as 6.39, for equity options, commodity options, foreign exchange options and similar products, if Strike price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g. 0.021 instead of 2.1%), for interest rate options, interest rate and credit swaptions quoted in spread, and similar products, if Strike price notation = 3	N	Transaction C if (Strike price) is not populated, and UPL[Instrument type] = 'Option', else (blank optional). The number of strike price values must equal the number of start date intervals. Collateral - NR Valuation - NR
68	CFTC	Non-standardized term indicator	Indicator of whether a derivative has one or more additional provisions that materially affect the price of the derivative and that have not been disclosed to the public.	Indicator of whether the swap transaction has one or more additional term(s) or provision(s), other than those disseminated to the public pursuant to part 43, ^{29,26} that materially affect(s) the price of the transaction.	Boolean	• True • False	Y	Transaction - C if [Cleared] = 'N', else (optional) NR if [Cleared] = 'Y' or 'I' Collateral - NR Valuation - NR
69	CDE	Day count convention [Fixed rate day count convention- legconvention-Leg 1] [Fixed rate day count convention- legconvention-Leg 2]	For each leg of a derivative, the day count convention used to determine how interest payments are calculated.	For each leg of the transaction, where applicable: day count convention (often also referred to as day count fraction or day count basis or day count method) that determines how interest payments are calculated. It is used to compute the year fraction of the calculation period, and indicates the number of days in the calculation period divided by the number of days in the year. See Appendix 3.2 for definitions of values.	Char(4)	• A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule • A002 = IC30365 • A003 = IC30Actual • A004 = Actual360 • A005 = Actual365Fixed • A006 = ActualActualICMA • A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 • A008 = ActualActualISDA • A009 = Actual365LorActuActubasisRule • A010 = ActualActualAFB • A011 = IC30360ICMAor30360basicrule	Y	Transaction – [Fixed rate day count convention – Leg 1] C if [Fixed rate payment frequency period – Leg 1] is populated, else (blank) [Fixed rate day count convention – Leg 2] C if [Fixed rate payment frequency period – Leg 2] is populated, else (blank)

^{29,26} The reporting counterparty may report this data element in a manner that reflects public dissemination under the requirements of any regulator (for example, under CFTC Part 43 or the TR Rules).

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
		[Floating rate day count convention- leg convention-Leg 1] [Floating rate-day count convention- leg convention-Leg 2]				• A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 • A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 • A014 = Actual365NL • A015 = ActualActualUltimo • A016 = IC30EPlus360 • A017 = Actual364 • A018 = Business252 • A019 = Actual360NL • A020 = 1/1 • NARR = Narrative		[Floating rate day count convention – Leg 1] CO/EQ C if [Floating rate payment frequency period – Leg 1] is populated, else (optional) CR/IR/FX O Transaction – CO/EQ C if [Payment] [Floating rate day count convention – Leg 2] CO/EQ C if [Floating rate payment frequency period – Leg 2] is populated, else (blank optional) CR/IR/FX O Collateral - NR Valuation - NR
70	CFTC	Floating rate reset frequency period [Floating rate reset frequency period- leg period-Leg 1] [Floating rate reset frequency period- leg period-Leg 2]	For each floating leg of a derivative, the period of the frequency of resets.	For each floating leg of the swap transaction where applicable, time unit associated with the frequency of resets, e.g., day, week, month, year or term of the stream.	Char(4)	• DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • YEAR = Yearly • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular • EXPI = Payment at term	Y	Transaction – [Floating rate reset frequency period – Leg 1] IR C if UPI, [Instrument type] = 'Swap' and UPI, Underlier type [Underlying Asset Type] ≠ 'Fixed - Fixed', and [Floating rate reset frequency period – Leg 2] is null, else (blank optional) When populated with 'EXPI', [Floating rate reset frequency period multiplier] must be '1' [Floating rate reset frequency period – Leg 2] IR C if UPI, [Instrument type] = 'Swap' and UPI, [Underlying Asset Type] ≠ 'Fixed - Fixed', and [Floating rate reset frequency period – Leg 1] is null, else (optional) Transaction – CR/FX/EQ/CO - NRQ

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Collateral - NR Valuation - NR
71	CFTC	Floating rate reset frequency period multiplier [Floating rate reset frequency period multiplier-leg multiplier- Leg 1] [Floating rate reset frequency period multiplier-leg multiplier- Leg 2]	For each floating leg of a derivative, the number by which the floating rate reset frequency period is multiplied to determine the frequency of periodic payment dates in respect of a reset.	For each floating leg of the swap transaction, where applicable, number of time units (as expressed by the Floating rate reset frequency period) that determines the frequency at which periodic payment dates for reset occur. For example, a transaction with reset payments occurring every two months is represented with a Floating rate reset frequency period of "MNT" (monthly) and a Floating rate reset frequency period multiplier of 2. This data element is not applicable if the Floating rate reset frequency period is "ADHO". If Floating rate reset frequency period is "EXPI", then the Floating rate reset frequency period multiplier is 1. If the reset frequency period is intraday, then the Floating rate reset frequency period multiplier is 0.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction - [Floating rate reset frequency period multiplier - Leg 1] C if [Floating rate reset frequency period - Leg 1] is populated and ≠ 'ADHO', else {blank}. [Floating rate reset frequency period multiplier - Leg 2] C if [Floating rate reset frequency period - Leg 2] is populated and ≠ 'ADHO', else {blank}. When [Floating rate reset frequency period - Leg 1] is populated with 'EXPI', [Floating rate reset frequency period multiplier - Leg 1] must be '1'. When [Floating rate reset frequency period - Leg 2] is populated with 'EXPI', [Floating rate reset frequency period multiplier - Leg 2] must be '1'. Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Clearing

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
72	CDE	Cleared	Indicator of whether a derivative has been cleared, or is intended to be cleared, by a clearing agency.	Indicator of whether the transaction has been cleared, or is intended to be cleared, by a central counterparty. ^{30 22}	Char(1)	- Y = Yes, centrally cleared, for beta and gamma transactions. - N = No, not centrally cleared. - I = Intent to clear, for alpha transactions that are planned to be submitted to clearing.	Y	Transaction - M Collateral - NR Valuation - NR
73	CDE	Central counterparty identifier	Identifier of the clearing agency that cleared the derivative.	Identifier of the central counterparty (CCP) that cleared the transaction. This data element is not applicable if the value of the data element "Cleared" is "N" ("No, not centrally cleared") or "I" ("Intent to clear").	Char(20)	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org).	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y', else (optional) When populated, the value shall match the value in [Counterparty 1 (reporting counterparty)] ² . NR if [Cleared] = 'N'; O if [Cleared] = 'I' Collateral - NR Valuation - NR
74	CFTC	Clearing account origin	Indicator of whether the clearing member acts as principal or agent.	Indicator of whether the clearing member acted as principal for a house trade or an agent for a customer trade.	Char(4)	- HOUS = House - CLIE = Client	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y'; NR if [Cleared] = 'N' or 'I'; else (optional) Collateral - NR Valuation - NR
75	CDE	Clearing member identifier	Identifier of the clearing member through which a derivative is cleared by a clearing agency.	Identifier of the clearing member through which a derivative transaction was cleared at a central counterparty. This data element is applicable to cleared transactions under both the agency clearing model and the principal clearing model. ^{31 28} In the case of the principal clearing model, the clearing member is identified as clearing member and also as a counterparty in both transactions resulting from clearing: (i) in the transaction between the central counterparty and the clearing member; and (ii) in the transaction between the clearing member and the counterparty to the original alpha transaction.	<u>Char(20)</u>, for an LEI code or <u>Varchar(72)</u>, for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or	<u>ISO 17442 LEI code</u> that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/www.gleif.org). <u>For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose.</u>	N	Transaction - C if [Cleared] = 'Y'; else (optional) NR if [Cleared] = 'N' or 'I' Collateral - NR Valuation - NR

^{30 22} References to "central counterparty" in CDE data element explanations should be read to mean clearing agency or, in Quebec, clearing house.

^{31 28} Reporting counterparties should report "clearing swaps" according to the agency clearing model.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				• In the case of the agency clearing model, the clearing member is identified as clearing member but not as the counterparty to transactions resulting from clearing. Under this model, the counterparties are the central counterparty and the client. This data element is not applicable if the value of the data element "Cleared" is "N" ("No, not centrally cleared") or "I" ("Intent to clear").	• Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	• An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.		
76	CFTC	Clearing receipt timestamp	Date and time, expressed using Coordinated Universal Time, that the original derivative was recorded as being received by the clearing agency for clearing.	The date and time, expressed in Coordinated Universal Time (UTC), the original swap was received by the derivatives clearing organization (DCO) for clearing and recorded by the DCO's system. ^{32,33}	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - C if ([Cleared] = 'Y' or ([Cleared] = 'I' and [Action type] = 'TERM') and [Event type] = 'CLRG') or ([Cleared] = 'I' and [Action type] = 'TERM' and [Event type] = 'CLAL') else (blank optional); NR if [Cleared] = 'N' Collateral - NR Valuation - NR
77	CFTC	Clearing exceptions and exemptions - Counterparty 1	Type of exemption from or exception to a mandatory clearing requirement applicable to Counterparty 1.	The type of clearing exception or exemption that Counterparty 1 has elected or otherwise falls under.^{33,34} All applicable exceptions and exemptions must be selected. The values may be repeated as applicable.	Char(4)	• AFFL = Inter-affiliate exemption, • OTHR = Other exceptions or exemptions <i>Additional values only relevant to CFTC:</i> • ENDU = End-user exception, • SMBK = Small bank exemption, • COOP = Cooperative exemption, • NOAL = No-action Letter	N	Transaction - O O if [Cleared] = 'N'; NR if [Cleared] = 'Y' or 'I' Collateral - NR Valuation - NR
78	CFTC	Clearing exceptions and exemptions – Counterparty 2	Type of exemption from or exception to a mandatory clearing requirement applicable to Counterparty 2.	Identifies the type of the clearing exception or exemption that Counterparty 2 has elected or otherwise falls under. All applicable exceptions and exemptions must be selected. The values may be repeated as applicable.	Char(4)	• AFFL = Inter-affiliate exemption, • OTHR = Other exceptions or exemptions <i>Additional values only relevant to CFTC:</i> • ENDU = End-user exception, • SMBK = Small bank exemption, • COOP = Cooperative exemption, • NOAL = No-action Letter	N	Transaction - O O if [Cleared] = 'N'; NR if [Cleared] = 'Y' or 'I' Collateral - NR Valuation - NR

^{32,29} References to "derivatives clearing organization" or "DCO" in CFTC data element explanations should be read to mean clearing agency or, in Quebec, clearing house.

^{33,30} Refer to Parts 3 and 5 of NI 94-101 *Mandatory Central Counterparty Clearing of Derivatives*. However, reporting counterparties may provide clearing exceptions for Data Elements # 77 and 78 that are relevant to CFTC. As a result, reporting counterparties should not need to report these data elements differently under the TR Rules compared to how they are reported for the CFTC.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Elements Related to Collateral and Margin

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
79	CDE	Collateralisation category	Indicator of whether there is an agreement in respect of collateral between the counterparties and the nature of the collateralisation.	Indicator of whether a collateral agreement (or collateral agreements) between the counterparties exists (uncollateralised/partially collateralised/one-way collateralised/fully collateralised). This data element is provided for each transaction or each portfolio, depending on whether the collateralisation is performed at the transaction or portfolio level, and is applicable to both cleared and uncleared transactions.	Char(4)	•UNCL •PRC1 •PRC2 •PRCL •OWC1 •OWC2 •OWP1 •OWP2 •FLCL	N	Transaction - NRM Collateral - M Valuation - NR
80	CFTC	Portfolio containing non-reportable component indicator	If collateral is reported on a portfolio basis, indicator of whether the portfolio includes derivatives exempted or excepted from reporting.	If collateral is reported on a portfolio basis, indicator of whether the collateral portfolio includes swap transactions exempt from reporting.	Boolean	• True • False	N	Transaction - NR Collateral - M Valuation - NR
81	CDE	Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the initial margin posted by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the central counterparty, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C C if ([Collateralisation category] = 'OWC1' or 'OWP1' or 'FLCL'), else (blank optional) ⁴⁴³¹ Valuation - NR

⁴⁴³¹ In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (eg. Because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
82	CDE	Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the initial margin posted by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the central counterparty, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral - C if ([Collateralisation category= 'OWC1' or 'OWP1' or 'FLCL'], else {blank ³⁵ optional ³² }) Valuation - NR
83	CDE	Currency of initial margin posted ³⁶ ³³	Currency in which the initial margin posted is denominated.	Currency in which the initial margin posted is denominated. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of posted initial margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if ([initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)] or [initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)] is populated, else {blank}) Valuation - NR
84	CDE	Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the initial margin collected by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the central counterparty as part of its investment activity.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = 'OWC2' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {blank ³⁷ optional ³⁴ }) ³⁴ ³⁴ Valuation - NR

³⁵³² In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g., Because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

³⁶³³ For portfolio with multiple currencies, it must be converted in to a single currency chosen by the reporting counterparty and reported.

³⁷³⁴ In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.				
85	CDE	Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the initial margin collected by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the central counterparty as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = OWC2 or 'OWP2' or 'FLCL'), else {blank optional} ^{38 35} Valuation - NR
86	CDE	Currency of initial margin collected ^{38 35}	Currency in which the initial margin collected is denominated.	Currency in which the initial margin collected is denominated. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of collected initial margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)] or [Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR

^{38 35} In the case where collateral agreements(s) exists but no initial margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

^{38 35} For portfolio with multiple currencies, it must be converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
87	CDE	Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut) ⁴⁴³²	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of variation margins posted for the portfolio/transaction. <u>The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model.</u> If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = 'PRC1' or 'PRCL' or 'OWC1' or 'OWP1' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {blankoptional}⁴⁴³³ Valuation - NR
88	CDE	Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of posted variation margins for the portfolio /transaction. <u>The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model.</u>	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = 'PRC1' or 'PRCL' or 'OWC1' or 'OWP1' or 'OWP2' or 'FLCL'), else {blankoptional}⁴⁴³³ Valuation - NR

⁴⁴³² This data element must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

⁴⁴³³ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

⁴⁴³³ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.				
89	CDE	Currency of variation margin posted	Currency in which the variation margin posted is denominated.	Currency in which the variation margin posted is denominated. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of posted variation margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Variation margin posted by the reporting counterparty (pre- haircut)] or [Variation margin posted by the reporting counterparty (post- haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR
90	CDE	Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut) ⁴³⁴⁰	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty before a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio/ transaction. <u>The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model.</u> If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = PRC2' or PRCL' or 'OWC2 or OWP1' or OWP2' or FLCL'), else {blank ⁴⁴⁴¹ optional} ⁴⁴⁴¹ Valuation - NR

⁴³⁴⁰ This data element must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

⁴⁴⁴¹ In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
91	CDE	Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty after a haircut is applied.	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one), and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transaction, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin collected after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio /transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	N	Transaction - NR Collateral C if ([Collateralisation category] = PRC2' or PRCL' or 'OWC2 or OWP1' or OWP2' or FLCL'), else {blank optional} ^{45/42} Valuation - NR
92	CDE	Currency of variation margin collected	Currency in which the variation margin collected is denominated.	Currency in which the variation margin collected is denominated. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, this data element reflects one of those currencies into which the reporting counterparty has chosen to convert all the values of collected variation margins.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral C if [Variation margin collected by the reporting counterparty (pre- haircut)] or [Variation margin collected by the reporting counterparty (post- haircut)] is populated, else {blank} Valuation - NR

^{45/42} In the case where collateral agreements(s) exists but no variation margin is exchanged primarily between the counterparties (e.g. because the exposure doesn't meet the negotiated threshold) for a given portfolio, report zero until such time an exchange/transfer occurs.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
93	GFTCC DE	Variation margin collateral portfolio code	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty that identifies the variation margin related to the open transactions that are included in the portfolio.	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty to the portfolio that tracks the aggregate variation margin related to a set of open derivative transactions. This data element is not applicable if the collateralisation was performed on a transaction level basis, or if there is no collateral agreement, or if no collateral variation margin is posted or received. The portfolio code is required for both collateral reporting and valuation reporting in order to link the 2 data sets.	Varchar(52)	Up to 52 alphanumeric characters ⁴⁶⁴³	N	Transaction – O Collateral – C if [Initial margin collateral portfolio code] is not populated, else (optional) Collateral – M Valuation – MValuation – C if [Initial margin collateral portfolio code] is not populated, else (optional)
94	GFTCC DE	Initial margin collateral portfolio code	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty that identifies the initial margin related to the open transactions that are included in the portfolio.	If collateral is reported on a portfolio basis, a unique code assigned by the reporting counterparty to the portfolio that tracks the aggregate initial margin of a set of open derivative transactions. This data element is not applicable if the collateralisation was performed on a transaction level basis, or if there is no collateral agreement, or if no collateral initial margin is posted or received. The portfolio code is required for both collateral reporting and valuation reporting in order to link the 2 data sets.	Varchar(52)	Up to 52 alphanumeric characters ⁴⁷⁴⁴	N	Transaction – O Collateral – C if [Variation margin collateral portfolio code] is not populated, else (optional) Collateral – M Valuation – MValuation – C if [Variation margin collateral portfolio code] is not populated, else (optional)

Data Elements Related to Actions and Events

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
95	CDE	Event timestamp	Date and time of occurrence of an event relating to a derivative.	Date and time of occurrence of the event <u>for which a report is made</u> . In the case of a modification agreed for a future date, this data element should reflect the date, the modification occurs (becomes effective) and not when it was negotiated. In the case of a correction, this data element should reflect the date and time as of when the correction is applicable. In the case of a clearing event, this data element should reflect the recorded date and time when the alpha transaction is accepted by the central counterparty (CCP) for clearing.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC. ⁴⁸⁴⁵	Any valid date/time based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction - M, The value shall be equal to or later than the value in [Execution timestamp] Collateral - M

⁴⁶⁴³ If collateralization was performed on a transaction level basis, "TRANSACTIONLEVEL" is accepted. "NOTAPPLICABLE" is accepted if (i) collateralization was performed on a portfolio basis and there is no VM portfolio code, or (ii) it is a submission from a DCO.

⁴⁷⁴⁴ If collateralization was performed on a transaction level basis, "TRANSACTIONLEVEL" is accepted. "NOTAPPLICABLE" is accepted if (i) collateralization was performed on a portfolio basis and there is no IM portfolio code, or (ii) it is a submission from a DCO.

⁴⁸⁴⁵ Both the date and time portion are required to be reported. The time element is as specific as technologically practicable. If the time portion is not available, report "00:00:00" for the time portion.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				In the case of collateral update, the date and time for which the information contained in the report is provided.				Valuation - NR
96	CDE	Level	Indicator of whether the report is in respect of a derivative or a position.	Indication whether the report is done at trade or position level. Position level report can be used as a supplement to trade level reporting to report post trade events and if individual trades have been replaced by the position.	Char(4)	• TCTN = Trade • PSTN = Position	N	Transaction - M Collateral - NR Valuation - NR
97	CDE	Event identifier	Unique identifier that links derivatives relating to an event.	Unique identifier to link transactions entering into and resulting from an event, which may be, but is not limited to, compression or other post trade risk reduction exercises, credit event, etc. The unique identifier may be assigned by the reporting counterparty or a service provider or CCP providing the service ^{49,46} .	Varchar(52)	ISO 17442 LEI code of the entity assigning the event identifier followed by a unique identifier up to 32 characters.	N	Transaction C if [Event type] = 'COMP' or 'CREV', else {blank ^{50,47} optional} Collateral - NR Valuation - NR
98	CDE	Action type ^{50,47}	Indicator of the type of action or reporting relating to the derivative or position.	Type of action taken on the transaction or type of end-of-day reporting. See Appendix 3.8 for a description of the allowable values.	Char(4)	• NEWT = New • MODI = Modify • CORR = Correct • EROR = Error • REVI = Revive • TERM = Terminate • PRTO = Transfer out • VALU = Valuation • MARU = Collateral/ Margin Update • POSC = Position Component	Y	Transaction - M, for valid Action type and Event type, see Appendix 3.5 Collateral - M, must equal 'MARU' Valuation - M, must equal 'VALU'

^{49,46} The identifier which relates to the same event should be unique per event.

^{50,47} Only one Action type value is allowed per submission. Multiple Action type values should not be submitted in one transaction report. For example, if a data element needs to be corrected on a previously submitted transaction that is getting terminated, the Correct (CORR) value should be submitted as a separate submission prior to the submission of the Terminate (TERM) transaction.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
99	CDE	Event type	Indicator of the type of lifecycle event or reason for the action referred to in Data Element Number 98.	Explanation or reason for the action being taken on the transaction. See Appendix 3.7 for a description of the allowable values.	Char(4)	• TRAD = Trade • NOVA = Novation/Step-in • COMP = Post trade risk reduction exercise • ETRM = Early termination • CLRG = Clearing • EXER = Exercise • ALOC = Allocation • CLAL = Clearing & Allocation • CREV = Credit Event • PTNG = Transfer • INCP = Inclusion in position • CORP = Corporate event • UPDT = Update	Y	Transaction C, for valid Action type and Event type, see Appendix 3.5 Collateral - NR Valuation - NR
100	CFTC	Amendment indicator	Indicator of whether an amendment to the derivative relates to an event.	Indicator of whether the modification of the transaction reflects newly agreed upon term(s) from the previously negotiated terms.	Boolean	• True • False	Y	Transaction C if [Action type] = 'MOD', else { blank optional } Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Valuation

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
101	CDE	Valuation amount ⁵⁴⁴⁸	Value of the derivative.	Current value of the outstanding contract without applying any valuation adjustments (some examples include XVA adjustment such as CVA, DVA, etc). Valuation amount is expressed as the exit cost of the contract or components of the contract, as of a single moment in time, not a change in value or cumulative change in value over a specified period of time, i.e., the price that would be received to sell the contract (in the market in an orderly transaction at the valuation date). The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the valuation amount. In particular, the valuation amount of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model.	Num(25,5)	Any numerical value.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M

⁵⁴⁴⁸ Valuation amount must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
102	CDE	Valuation currency	Currency in which the valuation amount is denominated.	Currency in which the valuation amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M
103	CDE	Valuation method	Source and method used to value the derivative.	Source and method used for the valuation of the transaction by the reporting counterparty. If at least one valuation input is used that is classified as mark-to-model in Appendix 3.3, then the whole valuation is classified as mark-to-model. If only inputs are used that are classified as mark-to-market in Appendix 3.3, then the whole valuation is classified as mark-to-market.	Char(1)	• MTMA = Mark-to-market • MTMO = Mark-to-model • CCPV = Clearing agency's valuation (Classification of valuation inputs are provided in Appendix 3.3)	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M, when populated with CCPV; [Cleared] must be 'Y'
104	CDE	Valuation timestamp	Date and time that the value of the derivative referred to in Data Element Number 101 was determined.	Date and time of the calculation of the last valuation marked to market, provided by the central counterparty (CCP) ⁵⁴⁹ or calculated using the current or last available market price of the inputs. If for example a currency exchange rate is the basis for a transaction's valuation, then the valuation timestamp reflects the moment in time that exchange rate was current.	YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ, based on UTC ⁵⁵⁰ . If the time element is not required in a particular jurisdiction, time may be dropped given that – in the case of representations with reduced accuracy – ISO 8601 allows the complete representation to be omitted, the omission starting from the extreme right-hand side (in the order from the least to the most significant).	Any valid date/time based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - M
105	CFTC	Next floating reference reset date [Next floating reference reset date – Leg 1] [Next floating reference reset date – Leg 2]	Next date on which the floating reference will reset.	The nearest date in the future that the floating reference resets on.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O Valuation - O

⁵⁴⁹ Reported by the clearing agency for cleared derivatives and by the derivatives dealer for uncleared derivatives.

⁵⁵⁰ The timestamp portion is not required to be represented for Valuation timestamp. The format must be reported as YYYY-MM-DD.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
106	CFTC	Last floating reference value [Last floating reference value-Leg 1] [Last floating reference value-Leg 2]	Value of the floating reference on the date referred to in Data Element Number 107.	The most recent sampling of the value of the floating reference for the purposes of determining cash flow. Ties to Last floating reference reset date data element.	Num(11,10)	Positive and negative values expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%)	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O
107	CFTC	Last floating reference reset date [Last floating reference reset date-Leg 1] [Last floating reference reset date-Leg 2]	Most recent date of the floating reference reset.	The date of the most recent sampling of the floating reference for the purposes of determining cash flow. Ties to Last floating reference value data element.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - O
108	CDE	Delta ⁵⁴⁵¹	Ratio of the change in the price of the derivative to the change in the price of the underlying interest of the derivative.	The ratio of the change in the price of an OTC derivative transaction to the change in the price of the underlier.	Num(25,5)	Any numeric value	N	Transaction - NR Collateral - NR Valuation - C if UPL [Instrument type] = 'Option', else (blank optional)

Data Elements Related to Packages

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
109	CFTC	Package indicator	Indicator of whether the derivative is a component of a package if (a) 2 or more derivatives that are reported separately by the reporting counterparty are entered into under a single agreement, or (b) 2 or more reports relate to the same derivative and the	Indicator of whether the swap transaction is part of a package transaction.	Boolean	• True • False	Y	Transaction - M Collateral - NR Valuation - NR

⁵⁴⁵¹ Delta must be reported daily regardless of whether there is a change in the value since the last reporting.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
			derivative cannot be reported using a single report as a result of the reporting requirements of one or more jurisdictions of Canada or one or more foreign jurisdictions.					
110	CDE	Package identifier ⁵⁵²	Identifier of the package referred to in Data Element Number 109.	Identifier (determined by the reporting counterparty) in order to connect • two or more transactions that are reported separately by the reporting counterparty, but that are negotiated together as the product of a single economic agreement. • two or more reports pertaining to the same transaction whenever jurisdictional reporting requirement does not allow the transaction to be reported with a single report to trade repositories. A package⁵⁵³ may include reportable and non-reportable transactions. This data element is not applicable • if no package is involved, or • to allocations Where the package identifier is not known when a new transaction is reported, the package identifier is updated as it becomes available.	Varchar(100)	Up to 100 alphanumeric characters. ⁵⁷⁵⁴	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True', else {blank^{optional}} Collateral - NR Valuation - NR
111	CDE	Package transaction price	Price of the package referred to in Data Element Number 109.	Traded price of the entire package in which the reported derivative transaction is a component. This data element is not applicable if • no package is involved, or • package transaction spread is used Prices and related data elements of the transactions (Price currency, Price notation, Price unit of measure) that represent individual components of the package are reported when available.	• Num(18,13), if Package transaction price notation = 1 • Num(11,10), if Package transaction price notation = 3⁵⁵⁵	• Any value, if Package transaction price notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g., 0.0257 instead of 2.57%), if Package transaction price notation = 3⁵⁵⁵	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True' and [Package transaction spread] is not populated, else {blank^{optional}} Collateral - NR

⁵⁵² To report a collar, this field should be populated to link the cap and floor legs. To report a straddle, this field should be populated to link the payer swaption and receiver swaption legs.

⁵⁵³ In addition, a "package transaction" also includes a transaction involving two or more instruments: (1) that is executed between two or more counterparties; (2) that is priced or quoted as one economic transaction with simultaneous or near simultaneous execution of all components; (3) where the execution of each component is contingent upon the execution of all other components; (4) where each component is assigned a Unique Swap Identifier (USI) or Unique Transaction Identifier (UTI); and (5) each component is reported separately.

⁵⁷⁵⁴ "UNKNOWN" is accepted when the value is not available.

⁵⁵⁵ Default value with all 9's, for any of the allowable formats, is accepted when the value is unknown. When [Package transaction price notation] = '1' use "99999.999999999999" (18 numerical characters including 13 decimal places). When [Package transaction price notation] = '3' use "9.999999999" (11 numerical characters including 10 decimal places).

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
				The Package transaction price may not be known when a new transaction is reported but may be updated later				Valuation - NR
112	CDE	Package transaction price currency	Currency in which the package transaction price is denominated.	Currency in which the Package transaction price is denominated. This data element is not applicable if: • no package is involved, or • Package transaction spread is used, or • Package transaction price notation = 3	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	N	Transaction - C if [Package transaction price notation] = '1', else {blankoptional} Collateral - NR Valuation - NR
113	CDE	Package transaction spread	Price of the package referred to in Data Element 109, expressed as a spread.	Traded price of the entire package in which the reported derivative transaction is a component of a package transaction. Package transaction price when the price of the package is expressed as a spread, difference between two reference prices. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used Spread and related data elements of the transactions (spread currency) that represent individual components of the package are reported when available. Package transaction spread may not be known when a new transaction is reported but may be updated later. ⁹⁹⁹⁹	• Num(18,13), if Package transaction spread notation = 1 • Num(11,10), if Package transaction spread notation = 3 • Num(5), if Package transaction spread notation = 4	• Any value, if Package transaction spread notation = 1 • Any value expressed as decimal (e.g. 0.0257 instead of 2.57%), Package spread price notation = 3 • Any integer value expressed in basis points (e.g. 257 instead of 2.57%), if Package transaction spread notation = 4	N	Transaction - C if [Package indicator] = 'True' and [Package transaction price] is not populated, else {blankoptional} Collateral - NR Valuation - NR
114	CDE	Package transaction spread currency	Currency in which the package transaction spread is denominated.	Currency in which the Package transaction spread is denominated. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used, or • Package transaction spread is expressed as decimal or basis points	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	N	Transaction - C if [Package transaction price notation] = '1', else {blankoptional} Collateral - NR Valuation - NR

⁹⁹⁹⁹ Default value with all 9's, for any of the allowable formats, is accepted when the value is unknown. When [Package transaction price notation] = '1' use "99999.99999999999999" (18 numerical characters including 13 decimal places). When [Package transaction price notation] = '3' use "9.999999999" (11 numerical characters including 10 decimal places). When [Package transaction spread notation] = '4' use "99999" (5 numerical characters with no decimal places).

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
115	CDE	Package transaction spread notation	Manner in which the package transaction spread is expressed.	Manner in which the Package transaction spread is expressed. This data element is not applicable if • no package is involved, or • Package transaction price is used.	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal • 4 = Basis points	N	Transaction - C if [Package transaction spread] is populated, else {blankoptional} Collateral - NR Valuation - NR
116	CDE	Package transaction price notation	Manner in which the package transaction price is expressed.	Manner in which the Package transaction price is expressed. This data element is not applicable if no package is involved	Char(1)	• 1 = Monetary amount • 3 = Decimal	N	Transaction - C if [Package transaction price] is populated, else {blankoptional} Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Product

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
117	CDE	Unique product identifier ⁶⁶⁵⁷	Identifier of a unique code assigned by the Derivatives Service Bureau for a type of derivative.	A unique set of characters that represents a particular OTC derivative.	Char(12)	A list of allowable values and their format will be published by the Derivatives Service Bureau (UPI issuer). Until the above UPI is available reporting counterparties will continue to report the product-related data elements unique to each TR.	Y	Transaction- M Collateral - NR Valuation - NR <u>M</u>
118	CDE	CDS index attachment point	Point at which the level of losses in the underlying portfolio of a credit default swap reduces the notional of a tranche.	Defined lower point at which the level of losses in the underlying portfolio reduces the notional of a tranche. For example, the notional in a tranche with an attachment point of 3% will be reduced after 3% of losses in the portfolio have occurred. This data element is not applicable if the transaction is not a CDS tranche transaction (index or custom basket).	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	N	Transaction - CR C if UPI. Underlier type = 'index tranche', else {blankoptional}; When populated, the value shall be less than the value in [CDS index detachment point]; .

⁶⁶ Refer to section 1.2.6 Use of UPI Instrument Types for explanation on Unique Product Identifiers⁵⁷ On February 20, 2025, the CSA published Coordinated Blanket Order 96-933 Re Temporary Exemptions from Derivatives Data Reporting Requirements Relating to the Unique Product Identifier for Commodity Derivatives. The Coordinated Blanket Order enables market participants to continue to report unique product identifiers for commodity derivatives as required under rules in effect at that time: <https://www.securities-administrators.ca/news/csa-announces-temporary-exemptions-for-derivatives-market-participants/>

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral - NR Valuation - NR
119	CDE	CDS index detachment point	Point beyond which losses in the underlying portfolio of a credit default swap no longer reduce the notional of a tranche.	Defined point beyond which losses in the underlying portfolio no longer reduce the notional of a tranche. For example, the notional in a tranche with an attachment point of 3% and a detachment point of 6% will be reduced after there have been 3% of losses in the portfolio. 6% losses in the portfolio deplete the notional of the tranche. This data element is not applicable if the transaction is not a CDS tranche transaction (index or custom basket).	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	N	Transaction - CR C if UPI. Underlier type = 'Index tranche', else { blankoptional }; When populated, the value shall be greater than the value in [CDS index attachment point]. Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral -NR Valuation -NR
120	CFTC	Index factor	Factor of the index version, or the percentage, used to determine the notional amount of a credit default swap.	The index version factor or percent, expressed as a decimal value, that multiplied by the Notional amount yields the notional amount covered by the seller of protection for credit default swap.	Num(11,10)	Any value between 0 and 1 (including 0 and 1), expressed as decimal (e.g., 0.05 instead of 5%).	Y	Transaction - CR C if UPI. Underlier type= 'Index' or 'Index tranche', else { blankoptional } Transaction – IR/FX/CO/EQ - NR Collateral NR Valuation NR
121	CDE	Crypto asset underlying indicator [Crypto asset underlying indicator – Leg 1] [Crypto asset underlying indicator – Leg 2]	Indicator of whether the underlying interest of the derivative is a crypto asset.	Indicator of whether the underlying of the derivative is crypto asset. This element should be reported as 'true' if any of the underlyings is a crypto asset (immediate or ultimate underlying as well as where the derivative is based on a mix of crypto assets and other underlyings).	Boolean	• trueTrue, if underlying is a crypto asset • falseFalse, if underlying is not crypto asset	N	Transaction – CO OM Collateral – NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
122	CDE	Custom basket code	Unique identifier for a custom basket of reference assets.	If the OTC derivative transaction is based on a custom basket, unique code assigned by the structurer of the custom basket to link its constituents. This data element is not applicable if no custom basket is involved or no unique code has been assigned to it.	Varchar(72)	ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) code of the basket structurer ⁶¹⁵⁸ followed by a unique identifier up to 52 alphanumeric characters.	N	Transaction – C if [Custom basket indicator] = 'True', else {blank optional} Collateral – NR Valuation – NR
123	CFTC	Custom basket indicator	Indicator of whether the derivative has a custom basket as its underlying interest.	Indicator of whether the swap transaction is based on a custom basket.	Boolean	• True • False	Y	Transaction -M Collateral - NR Valuation - NR
124	CDE	Basket constituent identifier	Identifier of a reference asset in the custom basket.	An identifier that represents a constituent of an underlying custom basket in line with the Underlier ID within the ISO 4914 UPI reference data elements, as maintained by the UPI Service Provider or in line with an identifier that would be reported as an Underlier ID (Other) where the UPI Underlier ID is 'OTHER'. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Varchar(350210) ⁶²	An identifier that can be used to determine an asset, index or benchmark included in a basket. ⁶² ⁶⁰ Up to 350 alphanumeric characters.	N	Transaction – C if [Custom basket indicator code] = 'True', else {blank optional} The number of constituent identifier values must equal the number of constituent unit of measure, number of units, and identifier source values. Collateral – NR Valuation - NR
125	CDE	Basket constituent identifier source	Source of the basket constituent identifier referred to in Data Element Number 124.	The origin, or publisher, of the associated Basket constituent identifier, in line with the Underlier ID source within the ISO 4914 UPI reference data elements as maintained by the UPI Service Provider or in line with the allowable value that would be reported as an Underlier ID (Other) source where the UPI Underlier ID is 'OTHER'. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Varchar(350100) ⁶¹	The origin, or publisher ⁶² , of the associated basket constituent identifier. ⁶⁰ Up to 350 alphanumeric characters.	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else {blank optional} The number of constituent identifier source values must equal the number of constituent identifier, unit of

⁶¹⁵⁸ The LEI code should represent the LEI of the entity assigning the basket code.

⁵⁹ Free-form text is permitted in this field.

⁶² In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶⁰ In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶¹ Free-form text is permitted in this field.

⁶² In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
								measure and number of units values. Collateral - NR Valuation - NR
126	CDE	Basket constituent number of units	Number of units of each reference asset in the custom basket.	The number of units of a particular constituent in a custom basket. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Num(18,13)	Any value greater than zero. ^{64 63}	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else { blankoptional } The number of constituent number of units values must equal the number of constituent identifier, unit of measure, and identifier source values. Collateral – NR Valuation - NR
127	CDE	Basket constituent unit of measure	Unit of measure in which the number of units referred to in Data Element Number 126 is expressed.	Unit of measure in which the number of units of a particular custom basket constituent is expressed. This data element is not applicable if no custom basket is involved.	Char Varchar (4)	ISO 20022 approved external UnitOfMeasureCode codeset ⁶⁴	N	Transaction – C if [Basket constituent identifier] is populated, else { blankoptional } The number of constituent unit of measure values must equal the number of constituent identifier, number of units, and identifier source values. Collateral – NR Valuation – NR

^{64 63} For commodities baskets where calculated formula of different % weights of indices are used, provide values without the %. For example, 10% should be reported as “10”.

⁶⁴ Other TR approved UnitOfMeasure codes (related to crypto transactions) are allowed for CSA.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
128	CDE	Underlier ID (Other) [Underlier ID (Other) – Leg 1] [Underlier ID (Other) – Leg 2]	Identifier of each underlying interest of the derivative.	The asset(s), index (indices) or benchmark underlying a contract or, in the case of a foreign exchange derivative, identification of index. ⁶⁵ This data element is applicable when the value of Underlier ID is submitted as 'OTHER' to the UPI service provider. ^{66,65}	Varchar(350210) ⁶⁶	An identifier ⁶⁷ that can be used to determine the asset(s), index (indices) or benchmark underlying a contract. Up to 350210 alphanumeric characters. For an 'Underlier ID' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier IDs see 3.9 in the Appendix.	N	Transaction – C if UPI.[Underlier ID ⁶⁸] = 'Other', else {blank ^{optional} } Collateral – NR Valuation - NR
129	CDE	Underlier ID (Other) source [Underlier ID (Other) source – Leg 1] [Underlier ID (Other) source – Leg 2]	Source of the Underlier ID (Other) referred to in Data Element Number 128.	The origin, or publisher, of the associated Underlier ID (Other). This data element is applicable when the value of Underlier ID source is submitted as 'OTHER' to the UPI service provider.	Varchar(350100) ⁶⁹	The origin, or publisher ^{70,71} , of the associated Underlier ID. Up to 350100 alphanumeric characters. For an 'Underlier ID source' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier ID source see 3.10 in the Appendix.	N	Transaction – C if [Underlier ID (Other)] is populated, else {blank} Collateral – NR Valuation - NR
130	CDE	Underlying asset trading platform identifier [Underlying asset trading platform identifier – Leg 1] [Underlying asset trading platform identifier – Leg 2]	Identifier of the platform on which the underlying interest referred to in Data Element Number 128 is traded.	For a platform (e.g. exchange) traded underlying asset, the platform on which the asset is traded. ⁷² This data element is not applicable to OTC derivative transactions with custom basket constituents.	Char(4)	ISO 10383 Segment Market Identifier Code (MIC)	N	Transaction – EQ/CR-O Collateral – NR Valuation - NR
131	CDE	Underlying asset price source [Underlying asset price source – Leg 1] [Underlying asset price source – Leg 2]	Source of the price used to determine the value or level of the underlying interest referred to in Data Element Number 128.	For an underlying asset or benchmark not traded on a platform, the source of the price used to determine the value or level of the asset or benchmark. This data element is not applicable to OTC derivative transactions with custom basket constituents.	Varchar(50) ⁷²	Up to 50 alphanumeric characters.	N	Transaction – O Collateral – NR Valuation - NR

⁶⁵ If more than one underlier exists, the derivative should be considered a basket and the corresponding basket fields should be used.

^{66,65} When a particular underlier ID is not supported by the UPI service provider (Underlier ID is 'Other'), that underlier ID is reported in this field to the trade repository.

⁶⁶ Free-form text is permitted in this field.

⁶⁷ In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁶⁸ Depending on the product DSB may use attributes with names such as Reference Rate, Underlying Instrument Index, Underlying instrument ISIN, Underlying instrument LEI, or another name to denote the asset or index underlying the derivative.

⁶⁹ Free-form text is permitted in this field.

^{70,71} In line with the Underlier ID within the UPI reference data elements, as maintained by the UPI service provider, or in accordance with section 5.2 of the CPMI-IOSCO Technical Guidance: Harmonization of the Unique Product Identifier.

⁷² The platform provided should be the platform from where the underlying asset gets its pricing information.

⁷² Free-form text is permitted in this field.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
132	CFTC	Embedded option type	Type of optional provision in a derivative.	Type of option or optional provision embedded in a contract.	Char(4)	• MDET = Mandatory early termination • OPET = Optional early termination • CANC = Cancelable • EXTND = Extendible • OTHR = Other	Y	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR

Data Elements Related to Payments and Settlement

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
133	CDE	Final contractual settlement date	Date in the agreement by which all obligations under the derivative are to be satisfied.	Unadjusted date as per the contract, by which all transfer of cash or assets should take place and the counterparties should no longer have any outstanding obligations to each other under that contract. For products that may not have a final contractual settlement date (e.g., American options), this data element reflects the date by which the transfer of cash or asset would take place if termination were to occur on the expiration date.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date.	N	Transaction - C if UPI.[ReturnorPayoutTrigger] is not 'Contract for Difference (CFD)', else {blankoptional}. When populated, - the value shall be equal to or later than the value in [Expiration date]. Collateral - NR Valuation - NR
134	CDE	Settlement location	Place of settlement of the derivative.	Place of settlement of the transaction as stipulated in the contract. This data element is only applicable for transactions that involve an offshore currency (i.e. a currency which is not included in the ISO 4217 currency list, for example CNH).	Char(2)	ISO 3166 Country codes (using two-letter code (alpha-2))	N	Transaction - O Collateral - NR Valuation - NR
135	CDE	Settlement currency [Settlement currency-Leg 1] [Settlement currency-Leg 2]	For each leg of the derivative, the currency in which the cash settlement is denominated.	Currency for the cash settlement of the transaction when applicable. For multi-currency products that do not net, the settlement currency of each leg. This data element is not applicable for physically settled products (e.g., physically settled swaptions).	Char(3)	Currencies included in ISO 4217 Currency codes.	Y	Transaction - C if UPI.[Delivery type] = 'Cash', else { blank optional} Collateral - NR Valuation - NR

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
136	CDE	Other payment amount ²⁴²³	Amount of each payment under the derivative except an option premium amount under Data Element Number 144.	Payment amounts with corresponding payment types to accommodate requirements of transaction descriptions from different asset classes.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction - C if [Other payment type] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
137	CDE	Other payment currency	Currency in which the other payment amount referred to in Data Element Number 136 is denominated.	Currency in which Other payment amount is denominated.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
138	CDE	Other payment date	Date on which the other payment amount referred to in Data Element Number 136 is to be paid.	Unadjusted date on which the Other payment amount is paid.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
139	CDE	Other payment payer	Identifier of the payer of the other payment amount referred to in Data Element Number 136.	Identifier of the payer of Other payment amount.	- Char(20) for an LEI code or - Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other

²⁴²³ The set of data elements related to other payments (Other payment type [#141], Other payment amount [#142], Other payment currency [#143], Other payment date [#144], Other payment payer [#139], Other payment receiver [#140]) can be reported multiple times in the case of multiple payments.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
					• Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.		payment type. Collateral - NR Valuation - NR
140	CDE	Other payment receiver	Identifier of the receiver of the other payment amount referred to in Data Element Number 136.	Identifier of the receiver of Other payment amount.	• Char(20) for an LEI code or • Varchar(72), for natural persons who are acting as private individuals and not eligible for an LEI per the ROC Statement - Individuals Acting in a Business Capacity or • Varchar(72), Internal identifier code for a non-reporting counterparty subject to Blocking Law	ISO 17442 LEI code that is included in the LEI data as published by the Global LEI Foundation (GLEIF, www.gleif.org/). For natural persons who are acting as private individuals(not eligible for an LEI per the ROC Statement – Individuals Acting in a Business Capacity): LEI of the reporting counterparty followed by a unique identifier assigned and maintained consistently by the reporting counterparty for that natural person(s) for regulatory reporting purpose. An internal identifier code as non-reporting counterparty identifier if such counterparty or transaction is subject to Blocking Law and the reporting counterparty has exemptive relief from such derivatives data reporting requirements.	N	Transaction - C if [Other payment amount] is populated, else {blank} If populated with multiple values, the number of values must equal the number of values populated in [Other payment type]. Collateral - NR Valuation - NR
141	CDE	Other payment type	Reason for the payment referred to in Data Element Number 136.	Type of Other payment amount. Option premium payment is not included as a payment type as premiums for option are reported using the option premium dedicated data element.	Char(4)	• UFRO = Upfront Payment, i.e., the initial payment made by one of the counterparties either to bring a transaction to fair value or for any other reason that may be the cause of an off-market transaction • UWIN = Unwind or Full termination, i.e., the final settlement payment made when a transaction is unwound prior to its end date; Payments that may result due to full termination of derivative transaction(s) • PEXH = Principal Exchange, i.e., Exchange of notional values for cross-currency swaps	Y	Transaction - CR C, at least one is required: ([Fixed rate] or [Spread] or [Other payment type] = 'UFRO')-, else optional Allowable values UWIN' and PEXH' are optional and independent of the above condition Transaction – IR/FX/EQ/CO O Collateral - NR Valuation - NR

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
142	CDE	Payment frequency period ²²⁴ [Fixed rate payment frequency period-Leg 1] [Fixed rate payment frequency period-Leg 2] [Floating rate payment frequency period-Leg 1] [Floating rate payment frequency period-Leg 2]	For each leg of a derivative, the unit of time of the frequency of payments.	For each leg of the transaction, where applicable: time unit associated with the frequency of payments, e.g., day, week, month, year or term of the stream.	Char(4)	• DAIL = Daily • WEEK = Weekly • MNTH = Monthly • YEAR = Yearly • ADHO = Ad hoc which applies when payments are irregular • EXPI²²⁵ = Payment at term	Y	Transaction – CR/IR/EQ/CO O when populated with 'EXPI', [Payment frequency period multiplier] must be '1' Transaction – FX - NR Collateral - NR Valuation - NR
143	CDE	Payment frequency period multiplier [Fixed rate payment frequency period multiplier-Leg 1] [Fixed rate payment frequency period multiplier-Leg 2] [Floating rate payment frequency period multiplier-Leg 1] [Floating rate payment frequency period multiplier-Leg 2]	For each leg of a derivative, the number by which the payment frequency period is multiplied to determine the frequency of periodic payment dates.	For each leg of the transaction, where applicable: number of time units (as expressed by the Payment frequency period) that determines the frequency at which periodic payment dates occur. For example, a transaction with payments occurring every two months is represented with a Payment frequency period of "MNTH" (monthly) and a Payment frequency period multiplier of 2. This data element is not applicable if the Payment frequency period is "ADHO." If Payment frequency period is "EXPI", then the Payment frequency period multiplier is 1. If the Payment frequency is intraday, then the Payment frequency period is "DAIL" and the Payment frequency multiplier is 0.	Num(3,0)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction – CR/IR/EQ/CO C if [Payment frequency period] ≠ 'ADHO', else {blank}. When [Payment frequency period] is populated with 'EXPI', [Payment frequency period multiplier] must be '1' Transaction – FX - NR Collateral - NR Valuation - NR
144	CDE	Option premium amount	Premium paid by a buyer of an option or swaption.	For options and swaptions of all asset classes, monetary amount paid by the option buyer. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	Num(25,5)	Any value greater than or equal to zero.	Y	Transaction C if UPI.[Instrument type] = 'Option', else {blank optional} Collateral - NR Valuation - NR

²²⁴ To represent quarterly payment, report [Payment frequency period] = 'MNTH' and [Payment frequency period multiplier] = '3'. For semi-annual payment, report [Payment frequency period] = 'MNTH' and [Payment frequency period multiplier] = '6'.

²²⁵ Throughout this Technical Manual, for the allowable value 'EXPI' in frequency period related data elements, two different descriptions 'Payment at term' and 'End of term' are being used which in essence has the same meaning and represents the frequency/rate of payment/quantity.

Data Element Number	Source	Data Element Name	Data Element Description (from Appendix A to the TR Rules)	Detailed Explanation of Data Element	Format	Values	Made Available to the Public	Validations
145	CDE	Option premium currency	Currency in which the premium referred to in Data Element Number 144 is denominated.	For options and swaptions of all asset classes, currency in which the option premium amount is denominated. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	Char(3)	Currencies included in ISO 4217.	Y	Transaction C if [Option premium amount] > 0, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
146	CDE	Option premium payment date	Date on which the premium referred to in Data Element Number 144 is paid.	Unadjusted date on which the option premium is paid.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction C if [Option premium amount] > 0, else {blank} Collateral - NR Valuation - NR
147	CDE	First exercise date	First date on which an option can be exercised.	First unadjusted date during the exercise period in which an option can be exercised. For European-style options, this date is same as the Expiration date. For American-style options, the first possible exercise date is the unadjusted date included in the Execution timestamp. For knock-in options, where the first exercise date is not known when a new transaction is reported, the first exercise date is updated as it becomes available. This data element is not applicable if the instrument is not an option or does not embed any optionality.	YYYY-MM-DD, based on UTC.	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	Y	Transaction C if UPI.[Instrument type] = 'Option', else { blankoptional } Collateral - NR Valuation - NR
148	CFTC	Fixing date [Fixing date-Leg 1] [Fixing date-Leg 2]	For each leg of a derivative, the date on which the reference rate is determined.	Describes the specific date when a non-deliverable forward as well as various types of FX OTC options such as cash-settled options will "fix" against a particular exchange rate, which will be used to compute the ultimate cash settlement.	YYYY-MM-DD	Any valid date based on ISO 8601 Date and time format.	N	Transaction – CR/IR/EQ/CO O Transaction - FX C if (UPI.[Instrument type] = 'Forward' or 'Option') and UPI.[Delivery type] = 'Cash', else { blankoptional } Collateral - NR Valuation - NR

2.1 Position reporting guidelines

Data Element Name	Detailed Explanation of Data Element	Position Reporting
Buyer identifier	Identifier of the counterparty that is the buyer, as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	Where Buyer Identifier is applicable, the buyer/seller determination is made on the net of all position components.
Seller identifier	Identifier of the counterparty that is the seller as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most forwards and forward-like contracts (except for foreign exchange forwards and foreign exchange non-deliverable forwards) • most options and option-like contracts including swaptions, caps and floors • credit default swaps (buyer/seller of protection) • variance, volatility and correlation swaps • contracts for difference and spreadbets This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Payer identifier and Receiver identifier.	Where Seller Identifier is applicable, the buyer/seller determination is made on the net of all position components.
Payer identifier [Payer identifier–Leg 1] [Payer identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the payer leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	Where Payer Identifier is applicable, the payer/receiver determination is made on the net of all position components.
Receiver identifier [Receiver identifier–Leg 1] [Receiver identifier–Leg 2]	Identifier of the counterparty of the receiver leg as determined at the time of the transaction. A non-exhaustive list of examples of instruments for which this data element could apply are: • most swaps and swap-like contracts including interest rate swaps, credit total return swaps, and equity swaps (except for credit default swaps, variance, volatility, and correlation swaps) • foreign exchange swaps, forwards, non-deliverable forwards This data element is not applicable to instrument types covered by data elements Buyer identifier and Seller identifier.	Where Receiver Identifier is applicable, the payer/receiver determination is made on the net of all position components.
Effective date	Unadjusted date at which obligations under the OTC derivative transaction come into effect, as included in the confirmation.	Effective date initially reported when position was entered into.
Unique transaction identifier (UTI)	A unique identifier assigned to all derivatives reported at the transaction or position level which identifies it uniquely throughout its lifecycle and used for all recordkeeping.	New UTI created for position.

Notional amount [Notional amount-Leg 1] [Notional amount-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: - For OTC derivative transactions negotiated in monetary amounts, the amount specified in the contract. - For OTC derivative transactions negotiated in non-monetary amounts, refer to Appendix 3.1 for converting notional amounts for non-monetary amounts. In addition: - For OTC derivative transactions with a notional amount schedule, the initial notional amount, agreed by the counterparties at the inception of the transaction, is reported in this data element. - For OTC foreign exchange options, in addition to this data element, the amounts are reported using the data elements Call amount and Put amount. - For amendments or lifecycle events, the resulting outstanding notional amount is reported; (steps in notional amount schedules are not considered to be amendments or lifecycle events); - Where the notional amount is not known when a new transaction is reported, the notional amount is updated as it becomes available.	The notional amount is calculated as the net of buyer/seller or payer/receiver position components.
Call amount [Call amount-Leg 1] [Call amount-Leg 2]	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to buy.	The call amount is calculated as the sum of all call amounts included in the position.
Put amount [Put amount-Leg 1] [Put amount-Leg 2]	For foreign exchange options, the monetary amount that the option gives the right to sell.	The put amount is calculated as the sum of all put amounts included in the position.
Notional quantity [Notional quantity-Leg 1] [Notional quantity-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable, for derivative transactions negotiated in non-monetary amounts with fixed notional quantity for each schedule period (e.g., 50 barrels per month). The frequency is reported in Quantity frequency and the unit of measure is reported in Quantity unit of measure.	The notional quantity is calculated as the net of buyer/seller position components' notional quantity.
Total notional quantity [Total notional quantity-Leg 1] [Total notional quantity-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: aggregate Notional quantity of the underlying asset for the term of the transaction. Where the Total notional quantity is not known when a new transaction is reported, the Total notional quantity is updated as it becomes available.	The total notional quantity is calculated as the net of buyer/seller position components' total notional quantity.
Price	Price specified in the OTC derivative transaction. It does not include fees, taxes or commissions. For commodity fixed/float swaps and similar products with periodic payments, this data element refers to the fixed price of the fixed leg(s). For commodity and equity forwards and similar products, this data element refers to the forward price of the underlying or reference asset. For equity swaps, portfolios swaps, and similar products, this data element refers to the initial price of the underlying or reference asset. For contracts for difference and similar products, this data element refers to the initial price of the underlier. This data element is not applicable to: - Interest rate swaps and forward rate agreements, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate and Spread may be interpreted as the price of the transaction. - Interest rate options and interest rate swaptions as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Commodity basis swaps and the floating leg of commodity fixed/float swaps as it is understood that the information included in the data element Spread may be interpreted as the price of the transaction. - Foreign exchange swaps, forwards and options, as it is understood that the information included in the data elements Exchange rate, Strike price, and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Equity options as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. - Credit default swaps and credit total return swaps, as it is understood that the information included in the data elements Fixed rate, Spread and Upfront payment (Other payment type: Upfront payment) may be interpreted as the price of the transaction. - Commodity options, as it is understood that the information included in the data elements Strike price and Option premium may be interpreted as the price of the transaction. Where the price is not known when a new transaction is reported, the price is updated as it becomes available. For transactions that are part of a package, this data element contains the price of the component transaction where applicable.	Volume Weighted Average Price.

Spread [Spread-Leg 1] [Spread-Leg 2]	For each leg of the transaction, where applicable: for OTC derivative transactions with periodic payments (e.g. interest rate fixed/float swaps, interest rate basis swaps, commodity swaps), • spread on the individual floating leg(s) index reference price, in the case where there is a spread on a floating leg(s). For example, USD-LIBOR-BBA plus .03 or WTI minus USD 14.65; or • difference between the reference prices of the two floating leg indexes. For example, the 9.00 USD "Spread" for a WCS vs. WTI basis swap where WCS is priced at 43 USD and WTI is priced at 52 USD.	Volume Weighted Average Spread.
Initial margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the clearing agency, i.e., committed credit lines. If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin posted for all derivatives in the same position.
Initial margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of initial margin that has been posted by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin posted relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include default fund contributions, nor collateral posted against liquidity provisions to the clearing agency, i.e., committed credit lines. - If the initial margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin posted for all derivatives in the same position.
Initial margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin after application of the haircut (if applicable), rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the clearing agency as part of its investment activity. If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of initial margin collected for all derivatives in the same position.
Initial margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of initial margin that has been collected by the reporting counterparty, including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. If the collateralisation is performed at portfolio level, the initial margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the initial margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the initial margin, rather than to its daily change. The data element refers both to uncleared and centrally cleared transactions. For centrally cleared transactions, the data element does not include collateral collected by the clearing agency as part of its investment activity.	Sum of initial margin collected for all derivatives in the same position.

	If the initial margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	
Variation margin posted by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the counterparty 1 (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of posted variation margins for the portfolio /transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Sum of variation margin posted for all derivatives in the same position.
Variation margin posted by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the variation margin posted by the reporting counterparty (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin posted relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin posted relates to such single transaction. This data element refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of variation margins posted for the portfolio/transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin posted. In particular, the variation margin posted of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin posted is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of variation margin posted for all derivatives in the same position.
Variation margin collected by the reporting counterparty (post-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the counterparty 1 (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin collected after application of the haircut (if applicable), cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio /transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the counterparty 1 and reported as one total value.	Sum of variation margin collected for all derivatives in the same position.
Variation margin collected by the reporting counterparty (pre-haircut)	Monetary value of the variation margin collected by the reporting counterparty (including the cash-settled one) and including any margin that is in transit and pending settlement unless inclusion of such margin is not allowed under the jurisdictional requirements. Contingent variation margin is not included. If the collateralisation is performed at portfolio level, the variation margin collected relates to the whole portfolio; if the collateralisation is performed for single transactions, the variation margin collected relates to such single transaction. This refers to the total current value of the variation margin, cumulated since the first reporting of collected variation margins for the portfolio/ transaction. The accounting convention applied to record the instrument in the books should not affect the variation margin collected. In particular, the variation margin collected of settled-to-market (STM) instruments should be determined in accordance with the same principles as for instruments recorded under the collateralized-to-market (CTM) accounting model. If the variation margin collected is denominated in more than one currency, those amounts are converted into a single currency chosen by the reporting counterparty and reported as one total value.	Sum of variation margin collected for all derivatives in the same position.
Valuation amount	Current value of the outstanding contract. Valuation amount is expressed as the exit cost of the contract or components of the contract, i.e., the price that would be received to sell the contract (in the market in an orderly transaction at the valuation date).	Sum of valuation amounts for all derivatives in the position or valuation of the position itself if it is evaluated as a single element.
Final contractual settlement date	Unadjusted date as per the contract, by which all transfer of cash or assets should take place and the counterparties should no longer have any outstanding obligations to each other under that contract. For products that may not have a final contractual settlement date (e.g., American options), this data element reflects the date by which the transfer of cash or asset would take place if termination were to occur on the expiration date.	Maximum of all final contractual settlement dates of all derivatives in the position.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

3 Appendix

From Revised CDE Technical Guidance – version 34: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI)⁷⁴

3.1 Notional amount

Product	Converted Amount
Equity options and similar products	Product of the strike price and the number of shares or index units
Equity forwards and similar products	Product of the forward price and the number of shares or index units
Equity dividend swaps and similar products	Product of the period fixed strike and the number of shares or index units
Equity swaps, portfolio swaps, and similar products	Product of the initial price and the number of shares or index units
Equity variance swaps and similar products	VarianceVega notional amount
Equity volatility swaps and similar products	Vega notional amount
Equity CFDs and similar products	Product of the initial price and the number of shares or index units
Commodity options and similar products	Product of the strike price, and the total notional quantity
Commodity forwards and similar products	Product of the forward price and the total notional quantity
Commodity fixed/float swaps and similar products	Product of the fixed price and the total notional quantity
Commodity basis swaps and similar products	Product of the last available spot price at the time of the transaction of the underlying asset of the leg with no spread and the total notional quantity of the leg with no spread
Commodity swaptions and similar products	Notional amount of the underlying contract
Commodity CFDs and similar products	Product of the initial price and the total notional quantity

Notes to the conversion table for derivatives negotiated in non-monetary amounts:

Note 1: for derivatives where the quantity unit of measure differs from the price unit of measure, the price or total quantity is converted to a unified unit of measure.

Note 2: if applicable to the derivative, the notional amount reflects any multipliers and option entitlements.

⁷⁴ CDE Technical Guidance – version 34: Harmonisation of critical OTC derivatives data elements (other than UTI and UPI), https://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20220829.pdf https://www.leiroc.org/publications/gls/Final_ROC202531-Revised-CDE-Technical-Guidance-Version-4.pdf

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Note 3: for basket-type contracts, the notional amount of the derivative is the sum of the notional amounts of each constituent of the basket.

3.2 Mapping of Day count convention allowable values to ISO 20022, FpML, and FIX/FIXML values

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{25 27}	FIX/FIXML code value ^{26 28}	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML code ^{27 29}	FpML definition
A001	IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February, and provided that the interest period started on a 30th or a 31st. This means that a 31st is assumed to be a 30th if the period started on a 30th or a 31st and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). This is the most commonly used 30/360 method for US straight and convertible bonds.	1	30/360 (30U/360 Bond Basis)	Mainly used in the United States with the following date adjustment rules: (1) If the investment is End-Of-Month and Date1 is the last day of February and Date2 is the last day of February, then change Date2 to 30; (2) If the investment is End-Of-Month and Date1 is the last day of February, then change Date1 to 30; (3) If Date2 is 31 and Date1 is 30 or 31, then change Date2 to 30; (4) If Date1 is 31, then change Date1 to 30. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f). [Symbolic name: ThirtyThreeSixtyUS]	30/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e). The number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360, calculated on a formula basis as follows: Day Count Fraction = $[360 \times (Y2 - Y1) + 30 \times (M2 - M1) + (D2 - D1)] / 360$ "D1" is the first calendar day, expressed as a number, of the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D1, will be 30; and "D2" is the calendar day, expressed as a number, immediately following the last day included in the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31 and D1 is greater than 29, in which case D2 will be 30 ^{28 30}

^{25 27} The information contained in this column refers to the ISO 20022 data dictionary.

^{26 28} The source of information contained in this column is FIX Trading Community, <http://fixmate.fixtrading.org/latestEP/>

^{27 29} The definitions contained herein are copyright 2006 by International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) and reproduced by permission of ISDA. All Rights Reserved.

^{28 30} Note that the algorithm defined for this day count fraction has changed between the 2000 ISDA Definitions and 2006 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19,20}	FIX/FIXML ^{19,20} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19,20} code	FpML definition
A002	IC30365	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month in a way similar to the 30/360 (basic rule) and a 365-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that a 31st is assumed to be the 30th and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th).					
A003	IC30Actual	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month in a way similar to the 30/360 (basic rule) and the assumed number of days in a year in a way similar to the Actual/Actual (ICMA). Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). The assumed number of days in a year is computed as the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of interest payments in the year.					
A004	Actual360	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period and a 360-day year.	6	Act/360	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 360. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e). [Symbolic name: ActThreeSixty]	ACT/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (e) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{29, 30}	FIX/FIXML ^{29, 30} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{29, 30} code	FpML definition
A005	Actual365Fixed	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period and a 365-day year.	7	Act/365 (FIXED)	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 365. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d). [Symbolic name: ActThreeSixtyFiveFixed]	ACT/365. FIXED	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (d) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365.
A006	ActualActualICMA	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and the assumed number of days in a year, i.e., the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of interest payments in the year. If the coupon period is irregular (first or last coupon), it is extended or split into quasi-interest periods that have the length of a regular coupon period and the computation is operated separately on each quasi-interest period and the intermediate results are summed up.	9	Act/Act (ICMA)	The denominator is the actual number of days in the coupon period multiplied by the number of coupon periods in the year. Assumes that regular coupons always fall on the same day of the month where possible. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). [Symbolic name: ActActICMA]	ACT/ACT. ICMA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (c). This day count fraction code is applicable for transactions booked under the 2006 ISDA Definitions. Transactions under the 2000 ISDA Definitions should use the ACT/ACT.ISMA code instead. A fraction equal to "number of days accrued/number of days in year", as such terms are used in Rule 251 of the statutes, by-laws, rules and recommendations of the International Capital Markets Association (the "ICMA Rule Book"), calculated in accordance with Rule 251 of the ICMA Rule Book as applied to non-US dollar-denominated straight and convertible bonds issued after 31 December 1998, as though the interest coupon on a bond were being calculated for a coupon period corresponding to the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19,20}	FIX/FIXML ^{19,20} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19,20} code	FpML definition
A007	IC30E360orEuroBondBasismodel1	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and the 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. However, if the last day of the maturity coupon period is the last day of February, it will not be assumed to be the 30th. It is a variation of the 30/360 (ICMA) method commonly used for eurobonds. The usage of this variation is only relevant when the coupon periods are scheduled to end on the last day of the month.	5	30E/360 (ISDA)	Date adjustment rules are: (1) if Date1 is the last day of the month, then change Date1 to 30; (2) if D2 is the last day of the month (unless Date2 is the maturity date and Date2 is in February), then change Date2 to 30. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (h). [Symbolic name: ThirtyEThreeSixtyISDA]	30E/360.I SDA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (h). Note the algorithm for this day count fraction under the 2006 ISDA Definitions is designed to yield the same results in practice as the version of the 30E/360 day count fraction defined in the 2000 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change. The number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 360, calculated on a formula basis as follows: $\text{Day Count Fraction} = \frac{[360 \times (Y2 - Y1) + 30 \times (M2 - M1) + (D2 - D1)]}{360}$. "D1" is the first calendar day, expressed as a number, of the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D1, will be 30; "D2" is the calendar day, expressed as a number, immediately following the last day included in the Calculation Period or Compounding Period, unless such number would be 31, in which case D2 will be 30.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19, 20}	FIX/FIXML ^{19, 20} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19, 20} code	FpML definition
A008	ActualActualISDA	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days of the interest period that fall (falling on a normal year, year) divided by 365, added to the actual number of days of the interest period that fall (falling on a leap year, year) divided by 366.	11	Act/Act (ISDA)	The denominator varies depending on whether a portion of the relevant calculation period falls within a leap year. For the portion of the calculation period falling in a leap year, the denominator is 366 and for the portion falling outside a leap year, the denominator is 365. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b). [Symbolic name: ActActISDA]	ACT/ACT. ISDA	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (b). Note that going from FpML 2.0 Recommendation to the FpML 3.0 Trial Recommendation the code in FpML 2.0 "ACT/365.ISDA" became "ACT/ACT.ISDA". The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365 (or, if any portion of that Calculation Period or Compounding Period falls in a leap year, the sum of (i) the actual number of days in that portion of the Calculation Period or Compounding Period falling in a leap year divided by 366 and (ii) the actual number of days in that portion of the Calculation Period or Compounding Period falling in a non-leap year divided by 365).
A009	Actual365LorActuActubasisRule	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and a 365-day year (if the coupon payment date is NOT in a leap year) or a 366-day year (if the coupon payment date is in a leap year).	14	Act/365L	The number of days in a period equal to the actual number of days. The number of days in a year is 365, or if the period ends in a leap year 366. Used for sterling floating rate notes. May also be referred to as ISMA Year. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (i). [Symbolic name: ActThreeSixtyFiveL]	ACT/365L	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (i). The actual number of days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 365 (or, if the later Period End Date of the Calculation Period or Compounding Period falls in a leap year, divided by 366).

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19, 21}	FIX/FIXML ^{19, 21} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19, 21} code	FpML definition
A010	ActualActualAFB	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days and a 366-day year (if 29 Feb falls in the coupon period) or a 365-day year (if 29 Feb does not fall in the coupon period). If a coupon period is longer than one year, it is split by repetitively separating full year subperiods counting backwards from the end of the coupon period (a year backwards from 28 Feb being 29 Feb, if it exists). The first of the subperiods starts on the start date of the accrued interest period and thus is possibly shorter than a year. Then the interest computation is operated separately on each subperiod and the intermediate results are summed up.	8	Act/Act (AFB)	The actual number of days between Date1 and Date2, the denominator is either 365 (if the calculation period does not contain 29 February) or 366 (if the calculation period includes 29 February). See also AFB Master Agreement for Financial Transactions - Interest Rate Transactions (2004) in Section 4. Calculation of Fixed Amounts and Floating Amounts, paragraph 7 Day Count Fraction, subparagraph (i). [Symbolic name: ActActAFB]	ACT/ACT. AFB	The Fixed/Floating Amount will be calculated in accordance with the "BASE EXACT/EXACT" day count fraction, as defined in the "Définitions Communes plusieurs Additifs Techniques" published by the Association Française des Banques in September 1994. The denominator is either 365 (if the calculation period does not contain 29 February) or 366 (if the calculation period includes 29 February) – where a period of longer than one year is involved, two or more calculations are made: interest is calculated for each full year, counting backwards from the end of the calculation period, and the remaining initial stub period is treated in accordance with the usual rule. When counting backwards for this purpose, if the last day of the relevant period is 28 February, the full year should be counted back to the previous 28 February unless 29 February exists, in which case, 29 February should be used.
A011	IC30360ICMAor30360basicrule	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for February. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be the 28th (or 29th). It is the most commonly used 30/360 method for non-US straight and convertible bonds issued before 1 January 1999.	4	30E/360 (Eurobond Basis)	Also known as 30/360.ISMA, 30S/360, or Special German. Date adjustment rules are: (1) If Date1 falls on the 31st, then change it to the 30th; (2) If Date2 falls on the 31st, then change it to the 30th. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (g). [Symbolic name: ThirtyEThreeSixty]	30E/360	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (g) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (f). Note that the algorithm defined for this day count fraction has changed between the 2000 ISDA Definitions and 2006 ISDA Definitions. See Introduction to the 2006 ISDA Definitions for further information relating to this change.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{29, 30}	FIX/FIXML ^{29, 30} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{29, 30} code	FpML definition
A012	IC30E2360orEurobondbasismodel2	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month, except for the last day of February whose day of the month value shall be adapted to the value of the first day of the interest period if the latter is higher and if the period is one of a regular schedule. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb of a non-leap year is assumed to be equivalent to 29 Feb when the first day of the interest period is the 29th, or to 30 Feb when the first day of the interest period is the 30th or the 31st. The 29th day of February in a leap year is assumed to be equivalent to 30 Feb when the first day of the interest period is the 30th or the 31st. Similarly, if the coupon period starts on the last day of February, it is assumed to produce only one day of interest in February as if it was starting on 30 Feb when the end of the period is the 30th or the 31st, or two days of interest in February when the end of the period is the 29th, or three days of interest in February when it is 28 Feb of a non-leap year and the end of the period is before the 29th.					

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19, 20}	FIX/FIXML ^{19, 20} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19, 20} code	FpML definition
A013	IC30E3360orEurobondbasismodel3	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. It is a variation of the 30E/360 (or Eurobond basis) method where the last day of February is always assumed to be the 30th, even if it is the last day of the maturity coupon period.					
A014	Actual365NL	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period, excluding any leap day from the count, and a 365-day year.	15	NL365	The number of days in a period equal to the actual number of days, with the exception of leap days (29 February) which are ignored. The number of days in a year is 365, even in a leap year. [Symbolic name: NLThreeSixtyFive]		
A015	ActualActualUltimo	Method whereby interest is calculated based on the actual number of days in the coupon period divided by the actual number of days in the year. This method is a variation of the ActualActualICMA method with the exception that it assumes that the coupon always falls on the last day of the month. Method equal to ACT/ACT.ISMA in the FpML model and Act/Act (ICMA Ultimo) in the FIX/FIXML model.	10	Act/Act (ICMA Ultimo)	The Act/Act (ICMA Ultimo) differs from Act/Act (ICMA) method only that it assumes that regular coupons always fall on the last day of the month. [Symbolic name: ActActISMAUltimo]	ACT/ACT. ISMA	The Fixed/Floating Amount will be calculated in accordance with Rule 251 of the statutes, by-laws, rules and recommendations of the International Securities Market Association, as published in April 1999, as applied to straight and convertible bonds issued after 31 December 1998, as though the Fixed/Floating Amount were the interest coupon on such a bond. This day count fraction code is applicable for transactions booked under the 2000 ISDA Definitions. Transactions under the 2006 ISDA Definitions should use the ACT/ACT.ICMA code instead.

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ^{19, 20}	FIX/FIXML ^{19, 20} code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML ^{19, 20} code	FpML definition
A016	IC30EPlus360	Method whereby interest is calculated based on a 30-day month and a 360-day year. Accrued interest to a value date on the last day of a month shall be the same as to the 30th calendar day of the same month. This means that the 31st is assumed to be the 30th and 28 Feb (or 29 Feb for a leap year) is assumed to be equivalent to 30 Feb. This method is a variation of the 30E360 method with the exception that if the coupon falls on the last day of the month, change it to 1 and increase the month by 1 (i.e., next month). Method equal to ThirtyEPlusThreeSixty in the FIX/FIXML model.	13	30E+/360	Variation on 30E/360. Date adjustment rules: (1) If Date1 falls on the 31st, then change it to the 30th; (2) If Date2 falls on the 31st, then change it to 1 and increase Month2 by one, i.e., next month. [Symbolic name: ThirtyEPlusThreeSixty]		
A017	Actual364	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period divided by 364. Method equal to Act364 in the FIX/FIXML model.	17	Act/364	The actual number of days between Date1 and Date2, divided by 364. [Symbolic name: Act364]		
A018	Business252	Method whereby interest is calculated based on the actual number of business days in the interest period divided by 252. Usage: Brazilian Currency Swaps. Method equal to BUS/252 in the FpML model and BusTwoFiftyTwo in the FIX/FIXML model.	12	BUS/252	Used for Brazilian real swaps, which is based on business days instead of calendar days. The number of business days divided by 252. [Symbolic name: BusTwoFiftyTwo]	BUS/252	The number of Business Days in the Calculation Period or Compounding Period in respect of which payment is being made divided by 252.
A019	Actual360NL	Method whereby interest is calculated based on the actual number of accrued days in the interest period, excluding any leap day from the count, and a 360-day year.	16	NL360	This is the same as Act/360, with the exception of leap days (29 February) which are ignored. [Symbolic name: NLThreeSixty]		
A020	1/1	If parties specify the Day Count Fraction to be 1/1 then in calculating the applicable amount, 1 is simply input into the calculation as the relevant Day Count Fraction. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a).	0	1/1	If parties specify the Day Count Fraction to be 1/1 then in calculating the applicable amount, 1 is simply input into the calculation as the relevant Day Count Fraction. See also 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a). [Symbolic name: OneOne]	1/1	Per 2006 ISDA Definitions, Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a) or Annex to the 2000 ISDA Definitions (June 2000 Version), Section 4.16. Day Count Fraction, paragraph (a).

Allowable value	ISO 20022 name	ISO 20022 definition ²⁴¹	FIX/FIXML code value	FIX/FIXML code value description	FIX/FIXML definition	FpML code	FpML definition
NARR	Narrative	Other method.			Other FIX/FIXML code values not listed above and FIX/FIXML code values that are reserved for user extensions, in the range of integer values of 100 and higher.		

3.3 Valuation method

Classification of valuation inputs

Bucket	Input used	Valuation method ²⁴¹
1	Quoted prices in active markets for identical assets or liabilities that the entity can access at the measurement date [IFRS 13:76/ASC 820-10-35-40]. A quoted market price in an active market provides the most reliable evidence of fair value and is used without adjustment to measure fair value whenever available, with limited exceptions. [IFRS 13:77/ASC 820-10-35-41] An active market is a market in which transactions for the asset or liability take place with sufficient frequency and volume to provide pricing information on an ongoing basis. [IFRS 13: Appendix A/ASC 820-10-20].	Mark-to-market
2	Quoted prices for similar assets or liabilities in active markets [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-47] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly)	Mark-to-market
3	Quoted prices for identical or similar assets or liabilities in markets that are not active [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(b)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly).	Mark-to-model – historic prices from inactive markets should not be directly used
4	Inputs other than quoted prices that are observable for the asset or liability, for example interest rates and yield curves observable at commonly quoted intervals, implied volatilities, credit spreads [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(c)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly)	Mark-to-market
5	Inputs that are derived principally from or corroborated by observable market data by correlation or other means ("market-corroborated inputs") [IFRS 13:81/ASC 820-10-35-48(d)] (other than quoted market prices included within bucket 1 that are observable for the asset or liability, either directly or indirectly).	Mark-to-model – the inputs can be derived "principally" from observable market data, meaning that unobservable inputs can be used
6	Unobservable inputs for the asset or liability. [IFRS 13:86/ASC 820-10-35-52] Unobservable inputs are used to measure fair value to the extent that relevant observable inputs are not available, thereby allowing for situations in which there is little, if any, market activity for the asset or liability at the measurement date. An entity develops unobservable inputs using the best information available in the circumstances, which might include the entity's own data, taking into account all information about market participant assumptions that is reasonably available. [IFRS 13:87-89/ASC 820-10-35-53 - 35-54A]	Mark-to-model – unobservable inputs are used

²⁴¹ The classification provided in this column is independent from IFRS 13/ASC 820 and is for the sole purpose of reporting critical data elements of OTC derivative transactions.

3.4 Collateralisation category

Value	Name	Definition
UNCL	Uncollateralised	There is no collateral agreement between the counterparties or the collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that no collateral (neither initial margin nor variation margin) has to be posted with respect to the derivative transaction.
PRC1	Partially collateralised: Counterparty 1 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty regularly posts only variation margin and that the other counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
PRC2	Partially collateralised: Counterparty 2 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty regularly posts only variation margin and that the reporting counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
PRCL	Partially collateralised	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that both counterparties regularly post only variation margin with respect to the derivative transaction.
OWC1	One-way collateralised: Counterparty 1 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the other counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
OWC2	One-way collateralised: Counterparty 2 only	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the reporting counterparty does not post any margin with respect to the derivative transaction.
OWP1	One-way/partially collateralised: Counterparty 1	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the reporting counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the other counterparty regularly posts only variation margin.
OWP2	One-way/partially collateralised: Counterparty 2	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that the other counterparty posts the initial margin and regularly posts variation margin and that the reporting counterparty regularly posts only variation margin.
FLCL	Fully collateralised	The collateral agreement(s) between the counterparties stipulates that both counterparties post initial margin and regularly post variation margin with respect to the derivative transaction.

3.5 Action and event reporting

The below table specifies the allowable combinations of [Action type] and [Event type]. It also sets out whether they apply at transaction level, position level or both. The last column of the table indicates when a given [Action type] can be reported without [Event type].

Event Type

Action Type

Action type & Event type combinations	Trade (TRAD)	Novation (NOVA)	Compression or Risk Reduction Exercise (COMP)	Early Termination (ETRM)	Clearing (CLRG)	Exercise (EXER)	Allocation (ALOC)	Clearing & Allocation (CLAL)	Credit Event (CREV)	Transfer (PTNG)	Corporate Event (CORP)	Upgrade (UPDT)	Inclusion In Position (INCP)	No Event Type Required
New (NEWT)	T	T,P	T		T	T	T	T		T,P	T,P	T ^{80 82}	P	
Modify (MODI)	T,P	T,P	T	T,P		T	T		T		T,P	T,P	P	P
Correct (CORR)														T,P
Terminate (TERM)		T,P	T	T,P	T	T	T	T	T		T,P		T,P ^{81 83}	
Error (EROR)														T,P
Revive (REVI)														T,P
Transfer out (PRTU) ^{82 84}										T,P				
Valuation (VALU)														T,P
Collateral (MARU)														T,P
Position component (POSC)														T

^{80 82} NEWT-UPDT is used for upgrading existing 'exotic', 'complex', or 'non-standard' swaps to accurately report and comply with the Technical Manual

^{81 83} If a derivative is traded and immediately added to a position, it must be reported using the action type 'POSC'. However, if a derivative is reported as a new transaction ('NEWT') but then later added into a position, it should be reported using the action type 'TERM' and event type 'INCP'.

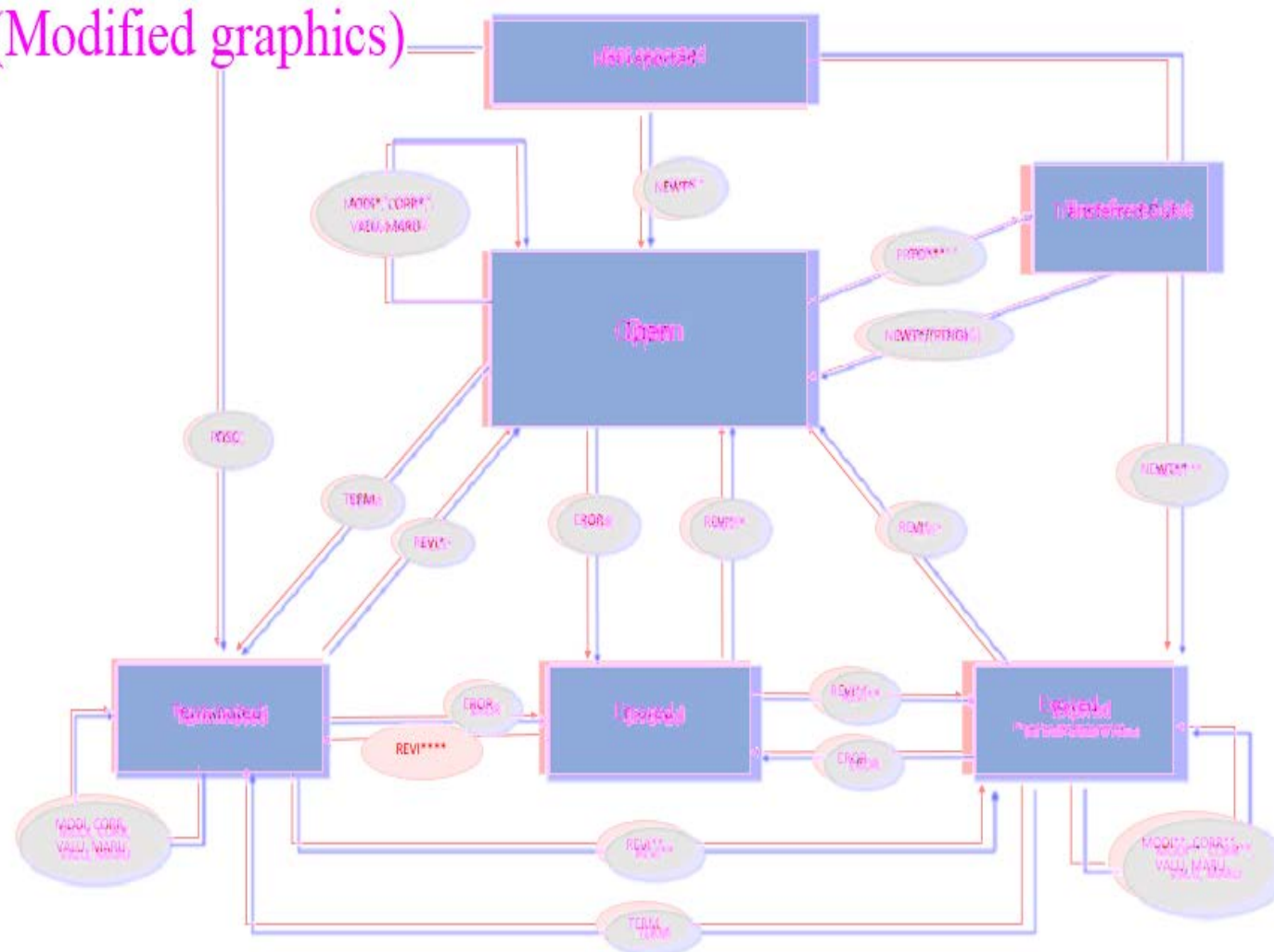
^{82 84} Any live or dead (terminated or expired) transactions can be transferred out except for the transactions that are previously reported as an error. Once a transaction is reported as 'transfer out' to a trade repository no further submission is allowed to the same trade repository for that transaction unless the transaction is transferred back in to the same trade repository. Combination 'NEWT-PTNG' should be used in this case.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

3.6 Allowable Action Type Sequences

(Modified graphics)



Reporting is facilitated by combinations of action type and event type. The action type sequence is designed to avoid illogical submissions by reporting counterparties. A submission with an action type that is not possible based on the previous action type should not satisfy the trade repository's validation procedure.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

(Mod)

Notes: The status of the derivative after revival; depends on the maturity date:
 Notes: The status of the derivative after revival; depends on the maturity date:
 * with Expiration Date >= today
 ** with Expiration Date < today
 *** PRTO is also accepted (but not expected) for termination or expired
 PRTO is also accepted for termination or expired

3.7 Definitions for Event Type Allowable Values

Event type	Allowable value	Definition
Trade	TRAD	Creation or modification of a transaction.
Novation/Step-in	NOVA	A novation or step-in legally moves part or all of the financial risks of a transaction from a transferor to a transferee and has the effect of terminating/modifying the original transaction so that it is either terminated or its notional is modified.
Post trade risk reduction exercise	COMP	Compressions and other post trade risk reduction exercises generally have the effect either of terminating or modifying (i.e., reducing the notional value) a set of existing transactions and/or of creating a set of new transaction(s). These processes result in largely the same exposure of market risk that existed prior to the event for the counterparty.
Early termination	ETRM	Termination of an existing transaction prior to expiration date.
Clearing	CLRG	Central clearing is a process where a central counterparty (CCP) interposes itself between counterparties to transactions, becoming the buyer to every seller and the seller to every buyer and thereby ensuring the performance of open transactions. It has the effect of terminating an existing transaction between the buyer and the seller.
Exercise	EXER	The full or partial exercise of an option or swaption by one counterparty of the transaction.
Allocation	ALOC	The process by which portions of a single transaction (or multiple transactions) are allocated to one or multiple different counterparties and reported as new transactions. ^{83 85}
Clearing & Allocation	CLAL	A simultaneous clearing and allocation event in a central counterparty (CCP).

^{83 85} Where a derivative is entered into by an agent of a counterparty and the transaction is executed before the derivative is allocated among the counterparties on whose behalf the agent is acting, we would prefer for the reporting counterparty not to report derivatives data in respect of the pre-allocation transaction and instead, once it receives and processes the allocation from the agent, to report only the allocated derivatives within the time periods set out in section 31 of the TR Rules. However, we would accommodate reporting in respect of the pre-allocation transaction as set out in this Technical Manual, and for that reason we have provided ALOC as an allowable value. Please also see Example 4.4.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Event type	Allowable value	Definition
Credit event	CREV	An event that results in a modification or a termination of a previously submitted credit transaction. Applies only to credit derivatives.
Transfer	PTNG	The process by which a transaction is transferred to another trade repository that has the effect of the closing of the transaction at one trade repository and opening of the same transaction using the same UTI in a different trade repository (new).
Inclusion in position	INCP	Inclusion of a CCP-cleared transaction or other fungible transactions into a position, where an existing transaction is terminated and either a new position is created or the notional of an existing position is modified.
Corporate event	CORP	The process by which a corporate action is taken on equity underlying that impacts the transactions on that equity.
Update	UPDT	Update of an outstanding transaction performed in order to ensure its conformity with the amended reporting requirements.

3.8 Definitions for Action Type Allowable Values

Action type	Allowable value	Definition
New	NEWT	The creation of the first transaction resulting in the generation of a new UTI.
Modify	MODI	A modification of the terms of a previously reported transaction due to a newly negotiated modification (amendment) or a filling in of not available missing information (e.g., post price transaction). It does not include correction of a previously reported transaction.
Correct	CORR	A correction of erroneous data of a previously reported transaction.
Terminate	TERM	A termination of a previously reported transaction.
Error	EROR	A cancellation of a wrongly submitted entire transaction in case it never came into existence or was not subject to the reporting requirements under the applicable law of a given jurisdiction, or a cancellation of a duplicate report.
Revive	REVI	An action that reinstates a reported transaction that was reported with action type "Error" or terminated by mistake or expired due to an incorrectly reported Expiration date.
Valuation	VALU	An update of a valuation of a transaction. There will be no corresponding Event type.
Collateral/Margin update	MARU	An update to collateral margin data. There will be no corresponding Event type.

Action type	Allowable value	Definition
Position component	POSC	A report of a new transaction that is included in a separate position report on the same day.
Transfer out	PRT0	A transfer of a transaction from one trade repository to another trade repository (change of trade repository).

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

3.9 Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other)

For an 'Underlier ID' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier IDs, please follow below guidance for the allowable values set out below. Note this is not exhaustive, and other types may be included.

<u>Asset Class</u>	<u>Underlier ID Type</u>	<u>Form of Underlier ID if not in golden source</u>
<u>Interest Rate</u>	<u>Floating Rate Index</u>	<u>ISDA FRO Name</u>
	<u>Debt Security Identifier</u>	<u>If no ISIN, then official registered name of the issuer—Maturity Date—Type of interest—Interest Rate—Interest Frequency—Debt Seniority</u>
	<u>Debt Index Identifier</u>	<u>Publisher's official long name of the index</u>
	<u>Inflation Index</u>	<u>ISDA FRO Name</u>
<u>Equity</u>	<u>Equity Index Name</u>	<u>Publisher's official long name of the index</u>
	<u>Equity Stock Identifier</u>	<u>If no ISIN (e.g. an unlisted stock), then official registered name of the stock—CFI 2nd character—CFI 3rd character</u>
	<u>Equity Index Identifier</u>	<u>Publisher's official long name of the index</u>
<u>Credit</u>	<u>Debt Security Identifier</u>	<u>If no ISIN, then official registered name of the issuer—Maturity Date—Type of interest—Interest Rate—Interest Frequency—Debt Seniority</u>
	<u>Debt Index Identifier</u>	<u>Publisher's official long name of the index</u>
	<u>Non-LEI entity identifier</u>	<u>Legal entity name as would be recorded in an LEI record</u>
<u>Commodity</u>	<u>Commodity Index</u>	<u>Publisher's official long name of the index</u>
	<u>Commodity Reference Price</u>	<u>ISDA CRP Name</u>
<u>Other</u>	<u>Exchange-traded future</u>	<u>If no ISIN, then MIC & Venue Product Code & F & F & YYYY-MM-DD & 0</u>
	<u>Exchange-traded option</u>	<u>If no ISIN, then MIC & Venue Product Code & O & P/C & YYYY-MM-DD & option strike price</u>
	<u>Digital Asset</u>	<u>ISO 24165 Digital Token Identifier</u>

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

3.10 Permitted allowable values for data element Underlier ID (Other) source

For an 'Underlier ID source' that does not exist in the golden source that is the reference data source for the UPI service provider's enumerations of Underlier ID source, please follow below guidance for the allowable values set out below. Note this is not exhaustive, and other types may be included.

<u>Asset Class</u>	<u>Underlier ID Type</u>	<u>Form of Underlier ID source</u>
<u>Interest Rate</u>	<u>Floating Rate Index</u>	<u>ISDA FRO Naming Convention</u>
	<u>Debt Security Identifier</u>	<u>CDE debt name and type</u>
	<u>Debt Index Identifier</u>	<u>Publisher's legal name</u>
	<u>Inflation Index</u>	<u>ISDA FRO Naming Convention</u>
<u>Equity</u>	<u>Equity Index Name</u>	<u>Publisher's legal name</u>
	<u>Equity Stock Identifier</u>	<u>CDE equity name and type</u>
	<u>Equity Index Identifier</u>	<u>Publisher's legal name</u>
<u>Credit</u>	<u>Debt Security Identifier</u>	<u>CDE debt name and type</u>
	<u>Debt Index Identifier</u>	<u>Publisher's legal name</u>
	<u>Non-LEI entity identifier</u>	<u>Entity name</u>
<u>Commodity</u>	<u>Commodity Index</u>	<u>Publisher's legal name</u>
	<u>Commodity Reference Price</u>	<u>ISDA CRP Naming Convention</u>
<u>Other</u>	<u>Exchange-traded future</u>	<u>All</u>
	<u>Exchange-traded option</u>	<u>All</u>
	<u>Digital Asset</u>	<u>ISO 24165 Digital Token Identifier</u>

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

4 Examples

4.1 SEF Transactions – Anonymous and cleared

This example illustrates the reporting of anonymous transactions that are subsequently cleared.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI	Notional amount	Execution timestamp	Clearing receipt timestamp	Submitter identifier	Central counterparty	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2	Cleared	Platform identifier
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	NULL	LEI1SEF0001	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
2	TERM	CLRG	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1RPT0001ALPHA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1SEF0001 LEI1CCP0004	NULL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	I	ABCD
3	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001BETA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI2CP0002	Y	NULL
4	NEWT	CLRG	2023-04-01T14:41:36Z	LEI1RPT0001GAMMA	LEI1RPT0001ALPHA	10000	2023-04-01T14:41:36Z	2023-04-01T14:40:36Z	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1CCP0004	LEI1RPT0001	Y	NULL

4.2 Package- Price/Spread

This example illustrates how to report package transactions based on either the price or spread.

Row 1 – Submission of a new package transaction but the package transaction price is not known yet.

Row 2 – Modifying the package transaction to update the package transaction price.

Row 3 – Submission of a new package transaction with a package transaction spread.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Package Indicator	Package identifier	Package transaction price	Package transaction price currency	Package transaction price notation	Package transaction spread currency	Package transaction spread notation	Package transaction spread notation	Price currency	Price currency	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001EEE	True	ABCD12	99999.999999999999	NULL	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	2023-04-05T16:14:36Z	LEI1RPT0001EEE	True	ABCD12	3.2	CAD	1	NULL	NULL	NULL	10.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	True	ABCD34	NULL	NULL	NULL	200	NULL	4	20.23	EUR	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

4.3 Partial Termination/Amendment, Correction

This example illustrates how different Action – Event type combinations are used to report changes to a previously submitted transaction.

Row	Action type	Event type	Amendment indicator	Event timestamp	Expiration date	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Embedded option type	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	MODI	TRAD	True	2023-04-02T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA			9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	MODI	TRAD	FALSEFalse	2023-04-03T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		OPET	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
4	CORR			2023-04-04T10:22:10Z	2024-01-01	LEI1RPT0001AAAA		EXTD	9000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.4 Allocation

This example illustrates how pre- and post- "Allocation" transactions are reported.

Row	Action type	Event type	Amendment indicator	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
2	TERM	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001PREAA		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEIFUNDMGR
3	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST1	LEI1RPT0001PREAA	4000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A1
4	NEWT	ALOC		2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001POST2	LEI1RPT0001PREAA	6000	2023-04-02T10:22:10Z	LEI1RPT0001	LEI2CP00A2

4.5 Position

This example illustrates how a derivative is reported when it is included in a position.

Row 1,2- Submitting new derivative that is the start of a new position on the same day [\(buy activity\)](#).

Row 3 - Submitting end of day valuation messages at position level.

Row ~~4~~[5](#)[4](#)[5](#)[6](#) – Submitting new derivative that is included in a position on the same day [\(buy and sell activity\)](#).

Row ~~6~~[7](#)[8](#)[7](#)[8](#)[9](#)[10](#)[11](#) – Submitting new derivative [\(alternative way of reporting trade\)](#) that is included in a position on the next day: [\(buy activity\)](#) (which means VALU messages will need to be sent for both [LEIRPT0001TRAD3](#) and [LEIRPT0001POSC1](#) on Jan 8 2023).

[Row 12](#) – Since [LEIRPT0001TRAD3](#) have been included into Position [LEIRPT0001POSC1](#) on Jan 9 2023, only VALU message for the Position [LEIRPT0001POSC1](#) need to be sent.

[Row 13](#) - Submitting sell activity to be included in Position [LEIRPT0001POSC1](#).

Row ~~9~~[10](#)[14](#) - Submitting early termination at position level due to sell activity.

~~Row 11 – Maintaining the position open and reporting a zero contract value on a daily basis.~~

[Row 15](#) - Submitting end of day valuation messages at position level.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Row 16 – Submitting sell activity to be included in Position LEIRPT0001POSC1.

Row ~~12~~17 – Termination of the position.

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Event identifier	UTI	Subsequent position UTI	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1	Counterparty 2	Level	Buyer identifier	Seller identifier	Valuation Amount	Price ⁸⁶
1	POSC		2023-01-05T14:02:34Z 2023-01-05T08:01:34Z		LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1,000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	NEWT	INCP	2023-01-05T14:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
3	VALU		2023-01-05T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1,000	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	1,245 1.68	
4	POSC		2023-01-07T08:01:34Z		LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	600 600	2023-01-06T12:01:34Z 2023-01-07T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		13
5	POSC		2023-01-07T08:02:34Z		LEIRPT0001TRAD8	LEIRPT0001POSC1	100	2023-01-07T08:02:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13
5 6	MODI	INCP	2023-01-07T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1,500	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.333
6 7	NEWT	TRAD	2023-01-08T18:01:34Z 2023-01-08T09:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	-	14
8	VALU		2023-01-08T18:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3		700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	23	
9	VALU		2023-01-08T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1,500	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	65	
7 10	TERM	INCP	2023-01-09T18:01:34Z		LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	700	2023-01-08T09:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002	-	14
8 11	MODI	INCP	2023-01-09T18:02:34Z		LEIRPT0001POSC1		2,200	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
9 12	MODI	ETRM	2023-01-10T15:01:34Z 2023-01-09T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		1,000 2,200	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	71.02	
13	POSC		2023-01-10T15:01:34Z		LEIRPT0001TRAD4	LEIRPT0001POSC1	1,200	2023-01-10T15:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.50
10 14	MODI	ETRM	2023-01-11T14:01:34Z 2023-01-10T15:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		0 1,000	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.922
11 15	VALU		2023-01-11T18:01:34Z 2023-01-10T18:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		0 1,000	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002	078	
16	POSC		2023-01-11T11:01:34Z		LEIRPT0001TRAD5	LEIRPT0001POSC1	1,000	2023-01-11T11:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEICP0002	LEIRPT0001		13.75
12 17	TERM	ETRM	2023-01-12T15:01:34Z 2023-01-11T11:01:34Z		LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T09:01:34Z 2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

4.5a Position – intraday

This example illustrates intraday trades where the net position at the end of the day is 0.

⁸⁶ The price values in this example are for illustrative purposes and will vary depending on the calculation methodology used.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Row	Action type	Event type	Event timestamp	UTI	Subsequent position UTI	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1	Counterparty 2	Level	Buyer identifier	Seller identifier	Valuation Amount	Price ⁸⁷
1	POSC		2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001TRAD1	LEIRPT0001POSC1	1.000	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12
2	POSC		2023-01-05T10:45:34Z	LEIRPT0001TRAD2	LEIRPT0001POSC1	400	2023-01-05T10:45:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.44
3	POSC		2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001TRAD3	LEIRPT0001POSC1	600	2023-01-05T14:04:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	TCTN	LEIRPT0001	LEICP0002		12.58
4	NEWT	INCP	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		0
5	TERM	ETRM	2023-01-05T18:01:34Z	LEIRPT0001POSC1		0	2023-01-05T08:01:34Z	LEIRPT0001	LEICP0002	PSTN	LEIRPT0001	LEICP0002		

4.6 Error and Revive

This example illustrates a derivative that was booked in error and subsequently cancelled, but needs to be revived as it was cancelled by mistake.

Row	Action type	Event type	Amendment Indicator	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Prior UTI (for one-to-one and one-to-many relations between transactions)	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD		2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
2	EROR			2023-04-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002
3	REVI			2023-04-05T14:21:36Z	LEI1RPT0001GGG		10000	2023-04-01T14:21:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

⁸⁷ The price values in this example are for illustrative purposes and will vary depending on the calculation methodology used.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

4.7 Crypto

Row	Action type	Event type	Derivative based on cryptoassets Crypto asset underlying indicator – Leg 1	Crypto asset underlying indicator – Leg 2	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Unique product identifier	Notional amount	Execution timestamp	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2
1	NEWT	TRAD	True	False	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001GGG	JESXCCQZ8VLPDHMET5	10000	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001	LEI2CP0002

4.8 Upgrade

This example illustrates how to report an upgrade event type in order to ensure its conformity with the amended reporting requirements.

Row 1: A new derivative executed on 2023-04-01.

Row 2: New reporting requirements were implemented, the existing derivative is reported as Modify-Upgrade (MODI-UPDT) in order to comply with the new requirements.⁸⁴⁸⁸

Row	Action type	Event type	Event timestamp	Unique transaction identifier (UTI)	Notional amount	Valuation Method	Execution timestamp	Collateralisation category	Counterparty 1 (reporting counterparty)	Counterparty 2	Platform identifier	Cleared
1	NEWT	TRAD	2023-04-01T14:15:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MarkToMarket	2023-04-01T14:15:36Z	FULLY	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	NULL	N
2	MODI	UPDT	2024-05-04T14:21:36Z	LEI1RPT0001FFF	10000	MTMA	2023-04-01T14:21:36Z	FLCL	LEI1RPT0001	LEI2CP0002	BILT	N

⁸⁴⁸⁸ Please note that the example provided is not an exhaustive list of the fields affected by the amended reporting requirements. Therefore, it is recommended that you review the rule to identify all fields that may be impacted.

[Link-to-previous setting changed from off in original to on in modified.].

Summary report:	
Litera Compare for Word 11.11.0.158 Document comparison done on 2026-07-29 16:11:24	
Style name: Default Style	
Intelligent Table Comparison: Active	
Original filename: 91-507 Derivatives Data Technical Manual_11-07-24_A.docx	
Modified filename: 91-507 Revised Derivatives Data Technical Manual_10-07-26_A.docx	
Changes:	
Add	740
Delete	595
Move From	0
Move To	0
Table Insert	51
Table Delete	16
Table moves to	0
Table moves from	0
Embedded Graphics (Visio, ChemDraw, Images etc.)	2
Embedded Excel	0
Format changes	0
Total Changes:	1404