



MISE A JOUR DE VOTRE STATUT CFTC

**DISPOSITIONS APPLICABLES AUX SEULS CLIENTS EN RELATION DIRECTE AVEC UNE
SALLE DE MARCHES**

Madame, Monsieur

Dans le cadre des opérations dérivées que vous réalisez avec notre Salle des Marchés, nous vous avons fait parvenir un questionnaire relatif aux réglementations américaines CFTC 2013 et CFTC 2020 en date du 12/12/2023.

Sauf erreur de notre part, nous n'avons pas reçu ce document complété et **signé**.

Pour rappel, BNP Paribas est enregistrée en tant qu'opérateur de swaps non américain (« registered non-US swap dealer ») auprès de l'autorité des marchés à terme aux Etats-Unis. En vertu de la Loi Dodd-Franck, la Commodity Futures Trading Commission (CFTC) impose des règles sur les transactions de swaps effectuées par des opérateurs de swaps avec certaines contreparties (telles qu'adopter des standards en matière de conduite des affaires, passer par des chambres de compensation, exécuter les opérations depuis des plateformes de négociation de swaps...).

Sans retour de ce questionnaire dûment complété et signé dans les 30 jours calendaires à compter de l'envoi de ce mail, et sur la base des informations en notre possession, nous considérerons votre société comme une Personne Non-Américaine au sens CFTC 2013 et CFTC 2020.

Document à retourner par mail à l'adresse suivante :

BCEF.SALLEDESMARCHESRETOURCFTC@bnpparibas.com

Dans l'hypothèse où vous auriez déjà retourné le questionnaire ci-après, vous n'avez pas à tenir compte du présent courrier.



Classification US Person au sens de la CFTC		Votre entité			
L'entité désignée confirme : - Être une Personne non américaine (Non-US Person) au sens de la directive CFTC 2013 et des règles CFTC 2020. ET - N'avoir aucun lien avec les Etats-Unis , qu'il soit comptable et/ou juridique et/ou financier.		Oui	Non		
Classification 2013/2020 US Person au sens de la CFTC		CFTC 2013		CFTC 2020	
Liens d'américanité					
Êtes vous une US Person ?		Oui	Non	Oui	Non
Êtes vous un Significant Risk Subsidiary ?				Oui	Non
Liens additionnels à déclarer, pour les Non US Persons					
Entité affiliée à une US Person		Oui	Non		
Entité garantie par une US Person		Oui	Non	Oui	Non
Pour une entité garantie par une US Person					
Garantie par une Entité Financière		Oui	Non	Oui	Non
Entité affiliée à un opérateur de swa		Oui	Non	Oui	Non

Il est de votre responsabilité de nous informer de tout changement susceptible de faire évoluer votre situation au regard de la réglementation CFTC au titre de 2013 et 2020.

Date :

Nom du Client :

SIREN :

Nom/Prénom du signataire représentant du Client :

Qualité :

Signature :



**ANNEXE DE DECLARATION RELATIVE AUX REGLES TRANSFRONTALIERES DE LA CFTC
2013 et 2020 CONCERNANT LES SWAPS
-DEFINITIONS -**

- « **CFTC** » s'entend de la Commodity Futures Exchange Commission des États-Unis.
- « **Directives d'interprétation de 2013 de la CFTC** » (*CFTC 2013 Interpretive Guidance*) s'entend du document de la CFTC intitulé *Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance With Certain Swap Regulations* (78 Fed. Reg. 45292 (26 juillet 2013)).
- « **Règles de 2020 de la CFTC** » (*CFTC 2020 Rules*) s'entend de la règle de la CFTC qui a été adoptée en vertu du document publié dans le Federal Register intitulé *Cross-Border Application of the Registration Thresholds and Certain Requirements Applicable to Swap Dealers and Major Swap Participants*, dans sa version modifiée de temps à autre (85 Fed. Reg. 56924 (14 septembre 2020)).
- « **Etats-Unis** » ou « **U.S.** » : les Etats-Unis d'Amérique, tout Etat des Etats-Unis, le District de Columbia, Puerto Rico, les Iles Vierges U.S. et tout autre territoire, possession, enclave, agence ou organe des Etats-Unis.
- « **Swap** » : sous réserve de certaines exclusions, les dérivés sur devises, taux d'intérêt et taux monétaires, titres exonérés, « broad-based security indices » et matières premières non financières (comme les métaux, l'énergie et les matières premières agricoles et environnementales) sont généralement considérés comme des Swaps. Sauf indication contraire, peuvent être également considérés comme un Swap, un produit qui ne porte pas sur un titre, un indice boursier « narrow-based » (restreint) ou un prêt individuel. *Veillez considérer la définition réglementaire se trouvant au paragraphe 1a(47) du Commodity Exchange Act.*
- « **Personnes Non Américaine (Non US Person)** » : toute personne qui n'est ni une Personne Américaine – Directives CFTC 2013 ni une Personne Américaine – Règles CFTC 2020.
- « **Personne Américaine (US Person) – Directives CFTC 2013** » :
 - (i) toute personne physique résidant aux Etats-Unis ; ou
 - (ii) tout bien d'une personne défunte qui résidait aux Etats-Unis au moment de son décès ; ou
 - (iii) toute société ou tout partenariat, société à responsabilité limitée, trust, , association, société par actions, fonds ou toute autre forme d'entreprise similaire aux entités précédemment citées (autre que les entités décrites aux points (iv) ou (v) ci-dessous) (ci-après une « Entité Juridique »), organisé ou constitué en vertu des lois d'un Etat ou de toute autre juridiction aux Etats-Unis, ou dont le principal centre d'activité est situé aux Etats-Unis ; ou
 - (iv) tout régime de retraite pour les employés, les cadres ou les responsables d'une Entité Juridique décrite au paragraphe (iii), à moins qu'il ne couvre principalement les employés étrangers de cette Entité ; ou
 - (v) tout trust régi par les lois d'un Etat ou de tout autre juridiction aux Etats-Unis, si un tribunal américain est en mesure d'assurer la supervision principale de son administration; ou
 - (vi) tout pool de matières premières, comptes communs, fonds d'investissement ou autre organisme de placement collectif non décrit au paragraphe (iii) et qui est détenu majoritairement par une ou plusieurs personnes décrites aux paragraphes (i), (ii), (iii), (iv) ou (v), à l'exception des pools de matières premières, comptes communs, fonds d'investissement ou organisme de placement collectif faisant l'objet d'une offre public réservée aux Personnes Non Américaines et n'étant pas proposée aux Personnes Américaines ; ou
 - (vii) toute Entité Juridique (autre qu'une entreprise à responsabilité limitée, une société en commandite simple ou une entité similaire dont tous les propriétaires ont des responsabilités limitées) qui est détenue majoritairement, directement ou indirectement, par une ou plusieurs personnes décrites aux paragraphes (i), (ii), (iii), (iv) ou (v) et pour laquelle ces personnes assument une responsabilité illimitée pour les obligations et les engagements de l' Entité Juridique ; ou
 - (viii) tout compte individuel ou compte joint (discrétionnaire ou non) dont le bénéficiaire effectif (ou l'un des bénéficiaires effectifs dans le cas d'un compte joint) est une personne décrite aux points (i), (ii), (iii), (iv), (v), (vi) ou (vii).



- **« Personne Américaine (US Person) - Règles CFTC 2020 » :**
 - (i) toute personne physique qui réside aux Etats-Unis; ou
 - (ii) tout partenariat ou toute société ou tout trust tout véhicule d'investissement ou tout autre personne morale organisée, constituée ou établie en vertu des lois d'un Etat ou de toute autre juridiction aux Etats-Unis, ou dont le principal centre d'activité est situé aux Etats-Unis ; ou
 - (iii) tout compte (discrétionnaire ou non discrétionnaire) d'une Personne Américaine; ou
 - (iv) tout bien d'une personne défunte qui résidait aux Etats-Unis au moment de son décès.

- **« Significant Risk Subsidiary » :** toute filiale qui est une Personne Non Américaine contrôlée, directement ou indirectement, par une Personne Américaine et qui remplit les conditions suivantes :
 - (i) La moyenne (sur les trois dernières années) du capital en actions de la filiale est égale ou supérieure à cinq pour cent de la moyenne (sur les trois dernières années) du capital en actions de la maison mère américaine, déterminé selon les normes U.S. GAAP à la fin de la plus récente année fiscale; ou
 - (ii) La moyenne (sur les trois dernières années) des revenus de la filiale est égale ou supérieure à dix pour cent de la moyenne (sur les trois dernières années) des revenus consolidés de la maison mère américaine, déterminé selon les normes U.S. GAAP à la fin de la plus récente année fiscale; ou exercice révolu; ou
 - (iii) La moyenne (sur les trois dernières années) des actifs de la filiale est égale ou supérieure à dix pour cent de la moyenne (sur les trois dernières années) des actifs consolidés de la maison mère américaine, déterminé selon les normes U.S. GAAP à la fin de la plus récente année fiscale;

ET

- (x) Sa maison mère américaine a plus de cinquante milliards d'actifs globaux consolidés, déterminé selon les normes U.S GAAP à la fin de la plus récente année fiscale; et

- (y) La Personne Non Américaine n'est pas soumise :
 - a. à la supervision et à la réglementation de la « Federal reserve Board » en tant que filiale directe ou indirecte d'une holding bancaire américaine ou d'une « intermediate holding company »; ou
 - b. à la fois, (i) aux normes de capital et à la supervision par le régulateur du pays de la personne qui n'est pas une Personne Américaine, qui sont cohérents avec le comité de Bâle sur la supervision bancaire (« International Regulatory Framework for Banks ») (« Basel III ») et (ii) aux appels de marge pour les Swaps non compensés (« nettés ») dans une juridiction que la commission a jugé comparable, suite à une étude comparative publiée concernant les exigences d'appel de marge sur les Swaps non compensés.

➤ **« U.S. Affiliate Conduit – Directives CFTC 2013 » :**

- i) toute Personne Non Américaine qui est une filiale détenue majoritairement par une Personne Américaine ; ou
- ii) toute Personne Non Américaine qui est une filiale détenue majoritairement par une Personne Américaine ou qui est contrôlée par une Personne Américaine ou qui est sous contrôle commun avec une Personne Américaine ; ou
- iii) toute Personne Non Américaine dont les résultats financiers sont inclus dans les états financiers consolidés d'une Personne Américaine;

ET

- iv) toute Personne Non Américaine qui, dans le cadre normal de ses activités courantes, (i) conclut des Swaps avec un ou plusieurs tiers non américains à des fins de couvertures ou d'atténuation des risques auxquelles sont exposés la ou les filiales d'une Personne Américaine ou (ii) prend des positions pour le compte de la ou des filiales d'une Personne Américaine, et conclut des Swaps ou d'autres accords de compensation avec les filiales d'une Personne Américaine afin de transférer les risques et les gains de ces Swaps avec des tiers aux filiales de la Personne Américaine.
- **« U.S. Guaranteed – Directive CFTC 2013 » :** toute Personne Non Américaine qui est affiliée à une Personne Américaine qui garantit les obligations de la Personne Non Américaine au titre



des Swaps. La garantie comprend tout accord ou dispositif dans le cadre duquel une personne s'engage à fournir un appui financier ou un financement en cas de pertes potentielles pouvant être subies par une autre personne au titre d'un Swap.

- « **U.S. Guaranteed – Règles CFTC 2020** » : toute Personne Non Américaine qui est garantie par une Personne Américaine en vertu d'un accord selon lequel une des parties prenantes dans le Swap a des droits de recours envers un garant qui est une Personne Américaine, en relation avec les obligations de la Personne Non Américaine dans le Swap. A cette fin, la partie prenante dans le Swap a des droits de recours envers un garant qui est une Personne Américaine si la partie prenante a un droit qui est juridiquement exécutoire (conditionnel ou inconditionnel) de recevoir ou collecter, en tout ou en partie, des paiements du garant qui est une Personne Américaine concernant les obligations de la partie prenante dans le Swap. En outre, dans le cas d'un accord selon lequel le garant a le droit juridiquement exécutoire (conditionnel ou inconditionnel) de recevoir ou collecter, en tout ou en partie, des paiements de tout autre garant concernant les obligations de la contrepartie dans le Swap, un tel accord sera considéré comme une garantie par l'autre garant des obligations dans le Swap.