

## AVENANT<sup>1</sup>

en date du .....<sup>2</sup>

### Entre

[●], [forme sociale] ayant son siège social [●], immatriculée [au Registre du commerce et des sociétés de [●] sous le numéro [●]], dûment représentée aux fins des présentes,

ci-après "**Partie A**" ;

et

[●], [forme sociale] ayant son siège social [●], immatriculée [au Registre du commerce et des sociétés de [●] sous le numéro [●]], dûment représentée aux fins des présentes,

ci-après "**Partie B**",

ensemble, les "**Parties**" ;

Les Parties ont précédemment conclu une ou plusieurs Conventions-Cadre Couvertes, Transactions Couvertes et/ou Documents de Garantie Couverts. Elles conviennent désormais de modifier chaque Convention-Cadre Couverte, Document de Transaction Couverte et/ou Document de Garantie Couvert selon les termes convenus dans le présent Avenant (l'"**Avenant**").

Par conséquent, les Parties sont convenues de ce qui suit:

---

<sup>1</sup> L'Avenant Bilateral EONIA publié par International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA), tel que modifié et complété, le cas échéant, (l'Avenant EONIA ISDA") est protégé par le droit d'auteur de l'ISDA 2020, et l'utilisation et la reproduction, dans les présentes, d'une partie de l'Avenant ISDA EONIA fait l'objet d'une autorisation de l'ISDA. La FBF et la documentation publiée par la FBF (la "Documentation FBF") ne sont pas affiliées à l'ISDA et l'ISDA n'a pas participé à la rédaction de la Documentation FBF. L'ISDA ne prend pas position et ne fait aucune déclaration ou garantie, expresse ou tacite, concernant l'adéquation de cet instrument à une utilisation dans le cadre d'une transaction particulière, et n'assume aucune responsabilité, qu'elle soit délictuelle ou contractuelle, pour toute utilisation de l'Avenant ISDA EONIA par incorporation dans la Documentation FBF. Les utilisateurs sont invités à consulter leur conseil juridique pour déterminer si cet instrument convient à l'utilisation envisagée.

La FBF fournit ce modèle d'Avenant pour faciliter les accords bilatéraux entre les Parties souhaitant modifier les références à l'EONIA dans leurs confirmations, documents de garantie ou conventions-cadre pour (i) inclure des clauses de repli à l'EONIA, ou (ii) changer la référence à l'EONIA par une référence à EuroSTR ou EuroSTR plus 8,5 points de base. L'utilisation de cet Avenant se fait sur une base volontaire.

<sup>2</sup> Sauf à ce qu'une autre date ne soit précisée dans la définition de la Date d'Effet de l'Avenant ci-dessous, il s'agit de la date à partir de laquelle l'Avenant est effectif.

## 1. **Modification du Taux Variable EONIA**

**[Non Applicable]**<sup>3</sup>/**[**

### 1.1. **Mise à jour de la définition de l'EONIA pour les besoins du Taux Variable EONIA**

**[Non Applicable]**<sup>4</sup>/**[**

Documents Couverts Spécifiés: **[Applicable]**/**[Non Applicable]**<sup>5</sup>

À compter de la Date d'Effet de l'Avenant (incluse), chaque Document de Transaction Couverte qui intègre une référence à EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE intègrera la définition d'EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE telle que prévue dans le Recueil de Taux 2021 et sera modifié de la manière suivante :

Les références à "EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE" seront considérées comme étant des références à "EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE" tel que défini dans le Recueil de Taux 2021**]**.

### 1.2. **Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR**

**[Non Applicable]**<sup>6</sup>/**[**

Documents Couverts Spécifiés : **[Applicable]**/**[Non Applicable]**<sup>7</sup>

À compter de la Date d'Effet de l'Avenant (incluse), chaque Document de Transaction Couverte qui intègre une référence à EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE intègrera la définition d'EUR-EuroSTR-CAPITALISE telle que prévue dans le Recueil de Taux 2021

---

<sup>3</sup> Si cet Avenant ne modifie que les documents de garantie, préciser "Non Applicable" et supprimer tous les sous-paragraphes 1.1, 1.2 et 1.3 tout en conservant le titre du paragraphe 1. Si cet Avenant modifie le Taux variable EONIA, insérer le sous-paragraphe 1.1, 1.2 ou 1.3 pertinent, préciser "Non Applicable" pour les paragraphes qui ne sont pas applicables et supprimer le reste de la formulation de ces paragraphes tout en conservant les titres.

<sup>4</sup> Ce sous-paragraphe, le sous-paragraphe 1.2 et le sous-paragraphe 1.3 sont alternatifs. Si le sous-paragraphe 1.1 n'est pas applicable (parce que le Taux Variable n'est pas mis à jour pour ajouter des clauses de repli mais est remplacé par le Taux Variable EuroSTR ou le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base), indiquer "Non Applicable" et supprimer le reste de la formulation du sous-paragraphe 1.1 tout en conservant le titre.

<sup>5</sup> Si seulement certains Documents de Transaction Couverte sont modifiés conformément au présent sous-paragraphe 1.1, indiquer l'option "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Applicable" et lister les Documents Couverts Spécifiés pertinents dans l'Annexe II sous le titre "A. Mise à jour de la définition d'EONIA pour les besoins du Taux Variable EONIA". Si tous les documents de Transaction Couverte doivent être modifiés conformément au présent sous-paragraphe 1.1, choisir "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Non Applicable".

<sup>6</sup> Ce sous-paragraphe, le sous-paragraphe 1.1 et le sous-paragraphe 1.3 sont alternatifs. Si le sous-paragraphe 1.2 n'est pas applicable (parce que le Taux Variable est mis à jour pour ajouter des clauses de repli ou qu'il est remplacé par le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base, mais qu'il n'est pas remplacé par le Taux Variable EuroSTR sans marge), indiquer "Non Applicable" et supprimer le reste du sous-paragraphe 1.2 tout en conservant le titre. Si ce sous-paragraphe 1.2 est applicable, insérer le sous- paragraphe 1.2.1. et examiner si le sous-paragraphe 1.2.2 doit ou non être inclus. A noter que ce sous-paragraphe 1.2 envisage de remplacer le Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR spécifié et n'inclut PAS une marge de 8,5 points de base. Pour ajouter cette marge de 8,5 points de base à l'EuroSTR qui sera composé quotidiennement avec l'EuroSTR, utiliser le sous-paragraphe 1.3 ci-dessous. Par ailleurs, toute marge que les documents pertinents ajoutent au Taux Variable EONIA sera ajoutée au Taux Variable EuroSTR en utilisant la même méthodologie (qui, si elle est spécifiée comme une "Marge" sans autre changement, se fera par le biais d'un simple intérêt à la fin de la Période d'Application).

<sup>7</sup> Si seulement certains Documents de Transaction Couverte sont modifiés conformément au présent sous-paragraphe 1.2, indiquer l'option "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Applicable" et lister les Documents Couverts Spécifiés pertinents dans l'Annexe II sous le titre "B. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR". Si tous les Documents de Transaction Couverte doivent être modifiés conformément au sous-paragraphe 1.2, choisir "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Non Applicable".

et sera modifié de la manière suivante :

**1.2.1. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR.**

A compter de la Date Pertinente<sup>8</sup> (incluse), les références à "EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE" seront considérées comme étant des références à "EUR-EuroSTR- CAPITALISE" tel que défini dans le Recueil de Taux 2021.

**1.2.2. Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte**

**[Non Applicable]**<sup>9</sup> **[Si, pour une Transaction Couverte, la Date Pertinente survient après le début de la Période d'Application mais avant la fin de cette Période d'Application, la référence à "EONIA<sub>i</sub>" dans la définition de "EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE" sera considérée comme remplacée par une référence à "EuroSTR<sub>i</sub>" (tel que défini dans le Recueil de Taux 2021) pour chaque jour 'i' concerné de cette Période d'Application qui survient [après la Date Pertinente]] à compter du premier jour 'i' de cette Période d'Application (inclus)]**<sup>10</sup>.

**1.3. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR majoré de 0,085%**

**[Non Applicable]**<sup>11</sup>

Documents Couverts Spécifiés : **[Applicable]** **[Non Applicable]**<sup>12</sup>

A compter de la Date de l'Effet de l'Avenant (incluse), chaque Document de Transaction Couverte qui intègre une référence à EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE intègrera la définition d'EUR-EuroSTR-CAPITALISE telle que prévue dans le Recueil de Taux 2021 et sera modifié de la manière suivante :

**1.3.1. Remplacement des Options de Taux Variable EONIA avec l'Option de Taux Variable EuroSTR majoré de 0,085%.**

A compter de la Date Pertinente<sup>13</sup>, les références à "EUR-EONIA-OIS-

<sup>8</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

<sup>9</sup> Ce sous-paragraphe 1.2.2 concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe 1.2.2 tout en conservant le titre.

<sup>10</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

<sup>11</sup> Ce sous-paragraphe et les sous-paragraphe 1.1 et 1.2 sont alternatifs. Si le sous-paragraphe 1.3 n'est pas applicable (parce que le Taux Variable EONIA est mis à jour pour ajouter des clauses de repli, ou parce que le Taux Variable est remplacé par le Taux Variable EuroSTR sans marge, au lieu d'être remplacé par le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base), indiquer "Non Applicable" et supprimer le reste du sous-paragraphe 1.3 tout en conservant le titre. Si ce sous-paragraphe est applicable, insérer le sous-paragraphe 1.3.1 et examiner si le sous-paragraphe 1.3.2 doit être inclus. A noter que ce sous-paragraphe 1.3 envisage de remplacer le Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR spécifié avec une marge de 8,5 points de base (qui sera capitalisée quotidiennement). Par ailleurs, toute marge que les documents pertinents ajoutent au Taux Variable EONIA sera ajoutée au Taux Variable EuroSTR en utilisant la même méthodologie (qui, si elle est spécifiée comme une "Marge" sans autre changement, se fera par le biais d'un simple intérêt à la fin de la Période d'Application).

<sup>12</sup> Si seulement certains Documents de Transaction Couverte sont modifiés conformément au présent sous-paragraphe 1.3, indiquer l'option "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Applicable" et lister les Documents Couverts Spécifiés pertinents dans l'Annexe II sous le titre "C. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base". Si tous les Documents de Transaction Couverte doivent être modifiés conformément au sous-paragraphe 1.2, choisir "Documents Couverts Spécifiés" comme étant "Non Applicable".

<sup>13</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

CAPITALISE" seront considérées comme étant des références à "EUR-EuroSTR- CAPITALISE" tel que défini dans le Recueil de Taux 2021, sous réserve que les définitions du Taux Recommandé par la BCE<sub>i</sub>, de l'EuroSTR<sub>i</sub> et du TFDE Ajusté (EuroSTR)<sub>i</sub> soient supprimées et remplacées par ce qui suit :

"**Taux Recommandé par la BCE<sub>i</sub>**" désigne, pour chaque jour "i" de la Période d'Application considérée, un taux de référence égal (i) au Taux Recommandé par la BCE pour ce jour, tel que publié ou fourni par son administrateur, plus (ii) 0.085% ;

"**EuroSTR<sub>i</sub>**" désigne pour chaque jour "i" de la Période d'Application considérée, un taux de référence égal à (i) l'EuroSTR pour ce jour tel que publié sur le Site Internet de la BCE, plus (ii) 0.085% ;

"**TFDE Ajusté (EuroSTR)<sub>i</sub>**" désigne, pour chaque jour "i" de la Période d'Application considérée, un taux de référence égal (i) au Taux de la Facilité de Dépôt Eurosysteme pour ce jour majoré de l'Ecart TFDE, plus (ii) 0.085%.

### 1.3.2. *Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*

**[Non Applicable]**<sup>14</sup>/[Si, pour une Transaction Couverte, la Date Pertinente survient après le début de la Période d'Application mais avant la fin de cette Période d'Application, la référence à "EONIA<sub>i</sub>" dans la définition de "EUR-EONIA-OIS-CAPITALISE" sera considérée comme remplacée par une référence à "EuroSTR<sub>i</sub>" (tel que défini au paragraphe 1.3 ci-dessus) pour chaque jour 'i' concerné de cette Période d'Application qui survient [après la Date Pertinente]] à compter du premier jour 'i' de cette Période d'Application (inclus)]<sup>15</sup>.]

## 2. **Modification de l'EONIA en tant que Taux de Référence ou Taux d'Intérêt (MV) sous tout Document de Garantie Couvert**

**[Non Applicable]**<sup>16</sup>/[

Documents Spécifiquement Couverts : **[Applicable]**/[**Non Applicable]**<sup>17</sup>

<sup>14</sup> Ce sous-paragraphe 1.3.2 concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe 1.3.2 tout en conservant le titre.

<sup>15</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

<sup>16</sup> Si aucune modification n'est apportée aux Documents de Garantie Couverts, préciser "Non Applicable" et supprimer les autres sous-paragraphe de ce paragraphe 2, tout en conservant le titre.

<sup>17</sup> Préciser "Applicable" pour "Documents Couverts Spécifiés" si les modifications pertinentes apportées par ce paragraphe ne s'appliquent qu'à certains documents spécifiés et non à tous les Documents de Garantie Couverts, auquel cas énumérer les Documents Couverts Spécifiés pertinents dans l'Annexe II sous le titre "D. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)" ou "E. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)", selon le cas. Si les modifications apportées par ce paragraphe s'appliquent à tous les Documents de Garantie Couverts, indiquer "Documents Couverts Spécifiés " comme étant "Non Applicable".

## 2.1. *Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral- Documents de Garantie Couverts*

À compter de la Date d'Effet de l'Avenant (incluse), chaque Document de Garantie Couvert intégrera l'Additif Technique Définitions Collateral<sup>18</sup>, dans sa version publiée le [●]<sup>19</sup> tel que modifié<sup>18</sup> tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux"<sup>19</sup> tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA"<sup>20</sup>.

## 2.2. *Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)*

[Non Applicable]<sup>21</sup> Nonobstant toute stipulation contraire dans tout Document de Garantie Couvert, à compter de la Date Pertinente<sup>22</sup>, le Taux de Référence ou le Taux d'Intérêt (MV) utilisé pour déterminer tout montant visé au paragraphe 6.5 de l'Annexe Remises en Garantie (tel que modifié, le cas échéant) ou tout Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, dû sur les espèces libellées en Euros pour toute période d'intérêt commençant à compter de la Date Pertinente, dans les conditions prévues par ce Document de Garantie Couvert sera "EONIA (Taux de Garantie)".<sup>23</sup>

### 2.2.1 *Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EONIA (Taux de Garantie).*

[Non Applicable]<sup>24</sup> Si la Date Pertinente survient après le début d'une période pour laquelle un montant visé au paragraphe 6.5 de l'Annexe Remises en Garantie (tel que modifié, le cas échéant) ou un Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, doit être déterminé selon les termes d'un Document de Garantie Couvert, mais avant la fin de cette période, ce montant ou Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, sera déterminé en utilisant "EONIA (Taux de Garantie)", pour chaque jour pertinent de cette période qui survient [après la Date Pertinente] à compter du premier jour de cette période (inclus)<sup>25</sup>.

<sup>18</sup> Les Parties peuvent choisir d'intégrer l'Additif Technique Définitions Collateral tel que modifié.

<sup>19</sup> Si cette option est sélectionnée, il n'est pas nécessaire d'inclure le paragraphe 2.2 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)*) ou le paragraphe 2.3 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)*), dans la mesure où, si le Taux de Référence ou le Taux d'Intérêt (MV) est "EONIA", il sera remplacé par "EONIA (Taux de Garantie)", conformément aux stipulations de l'Additif Technique Définitions Collateral, à la Date d'Effet de l'Avenant.

<sup>20</sup> Si cette option est sélectionnée, il n'est pas nécessaire d'inclure le paragraphe 2.2 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)*) ou le paragraphe 2.3 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)*), dans la mesure où, si le Taux de Référence ou le Taux d'Intérêt (MV) est "EONIA", il sera remplacé par "EONIA (Taux de Garantie)", conformément aux stipulations de l'Additif Technique Définitions Collateral, à la Date d'Effet de l'Avenant.

<sup>21</sup> Si les Documents de Garantie Couverts sont modifiés pour faire référence à l'EuroSTR (Taux de Garantie) à la place de l'EONIA (Taux de Garantie) préciser "Non applicable" et supprimer le reste du sous-paragraphe 2.2 ainsi que le sous-paragraphe 2.2.1, tout en conservant le titre du présent sous-paragraphe 2.2.

<sup>22</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

<sup>23</sup> Si les Parties ont intégré l'Additif Technique Définitions Collateral, tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux" ou "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA", alors si le Taux de Référence ou le Taux d'Intérêt (MV) est "EONIA", il sera remplacé par "EONIA (Taux de Garantie)" en application des stipulations de l'Additif Technique Définitions Collateral, à la Date d'Effet de l'Avenant, même sans inclure le présent sous-paragraphe 2.2. Les Parties peuvent néanmoins souhaiter inclure le présent sous-paragraphe 2.2 si (a) elles souhaitent préciser une date différente à laquelle le remplacement de "EONIA" par "EONIA (Taux de Garantie)" doit prendre effet, (b) si les parties n'ont pas choisi d'appliquer "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les taux" ou "Remplacement du Taux d'Intérêt: EONIA", ou (c) pour des raisons de transparence accrue.

<sup>24</sup> Ce sous-paragraphe 2.2.1 concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe tout en conservant le titre.

<sup>25</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la

### 2.3. **Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)**

**[Non Applicable]**<sup>26</sup> **[**Nonobstant toute stipulation contraire dans tout Document de Garantie Couvert, à compter de la Date Pertinente<sup>27</sup>, le Taux de Référence ou le Taux d'Intérêt (MV) utilisé pour déterminer tout montant visé au paragraphe 6.5 de l'Annexe Remises en Garantie (tel que modifié, le cas échéant) ou tout Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, dû sur les espèces libellées en Euros pour toute période d'intérêt commençant à compter de la Date Pertinente, dans les conditions prévues par ce Document de Garantie Couvert sera "EuroSTR (Taux de Garantie)".**]**

#### 2.3.1. **Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EuroSTR (Taux de Garantie).**

**[Non Applicable]**<sup>28</sup> **[**Si la Date Pertinente survient après le début d'une période pour laquelle un montant visé au paragraphe 6.5 de l'Annexe Remises en Garantie (tel que modifié, le cas échéant) ou un Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, doit être déterminé selon les termes d'un Document de Garantie Couvert, mais avant la fin de cette période, ce montant ou Montant d'Intérêt (MV), selon le cas, sera déterminé en utilisant "EuroSTR (Taux de Garantie)", pour chaque jour pertinent de cette période qui survient **[**après la Date Pertinente**]** à compter du premier jour de cette période (inclus)<sup>29</sup>.**]**

### 3. **Modification des autres références à l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes et les Documents de Transaction Couverte**

**[Non Applicable]**<sup>30</sup>**[**

Documents Couverts Spécifiés: **[Applicable]**/**[Non Applicable]**<sup>31</sup>

#### 3.1. **Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral - Conventions-Cadre Couvertes et Documents de Transaction Couverte**

A compter de la Date de l'Effet de l'Avenant (inclusive), **[**chaque Convention-Cadre Couverte**]** et **[**chaque Document de Transaction Couverte**]** intègrera l'Additif Technique

---

Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

<sup>26</sup> Si les Documents de Garantie Couverts sont modifiés pour faire référence à l'EuroSTR (Taux de Garantie) au lieu de l'EONIA (Taux de Garantie) préciser "Non Applicable" et supprimer le reste du sous- paragraphe 2.3 ainsi que le sous- paragraphe 2.3.1, tout en conservant le titre du présent sous-paragraphe 2.3.

<sup>27</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

<sup>28</sup> Ce sous-paragraphe 2.2.1 concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe tout en conservant le titre.

<sup>29</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

<sup>30</sup> Les Parties peuvent souhaiter inclure ce paragraphe 3 si elles ont des Transactions Couvertes ou des Conventions-Cadre Couvertes qui incluent une référence autonome à l'EONIA (par opposition au Taux Variable EONIA). Si aucune modification n'est apportée à des références autonomes à l'EONIA dans la documentation des transactions et les convention-cadre, préciser "Non Applicable" et supprimer le reste du paragraphe 3, tout en conservant le titre.

<sup>31</sup> Préciser "Applicable" pour "Documents Couverts Spécifiés" si les modifications pertinentes apportées par le présent paragraphe 3 ne s'appliquent qu'à certains documents spécifiés et non à toutes les Conventions-Cadre Couvertes ou Documents de Transaction Couverte, auquel cas énumérer les Documents Couverts Spécifiés pertinents dans l'Annexe II sous le titre " F. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)" et/ou "G. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)", selon le cas. Si les modifications apportées par ce paragraphe s'appliquent à tous les Documents de Garantie Couverts, indiquer "Documents Couverts Spécifiés " comme étant "Non Applicable".

Définitions Collateral<sup>32</sup>, dans sa version publiée le [●]<sup>32</sup> [tel que modifié]<sup>33</sup> [tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux"]<sup>34</sup> [tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA"]<sup>35</sup>.

### 3.2. *Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte avec EONIA (Taux de Garantie)*

[Non Applicable]<sup>36</sup>/[A compter de la Date Pertinente<sup>37</sup>(incluse), toute référence à l'EONIA dans une Convention-Cadre Couverte ou un Document de Transaction Couverte sera remplacée par une référence à "EONIA (Taux de Garantie)"<sup>38</sup>].

#### 3.2.1. *Période d'Application et Période d'Intérêt Rompues dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EONIA (Taux de Garantie)*

[Non Applicable]<sup>39</sup>/[Si la Date Pertinente survient après le début d'une période d'application ou d'une période d'intérêt (quel que soit le terme utilisé) dans le cadre d'une Convention-Cadre Couverte ou un Document de Transaction Couverte (pour laquelle des montants seraient, en l'absence du présent Avenant, calculés par référence à l'EONIA), mais avant la fin de cette période d'application ou de cette période d'intérêt, le montant pour cette période d'application ou cette période d'intérêt sera déterminé en utilisant "EONIA (Taux de Garantie)", pour chaque jour pertinent de cette période qui survient [après la Date Pertinente]<sup>40</sup> à compter du premier jour de cette période<sup>40</sup>].

---

<sup>32</sup> Si les Parties ont intégré l'Additif Technique Définitions Collateral dans sa version en vigueur à la date du présent Avenant (par opposition à cet additif technique tel que modifié), il convient d'insérer la date de publication de la version pertinente de l'Additif Technique Définitions Collateral.

<sup>33</sup> Les Parties peuvent choisir d'intégrer l'Additif Technique Définitions Collateral, tel que modifié.

<sup>34</sup> Si "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux" est applicable, tout indice de taux d'intérêt défini dans le document pertinent sera remplacé par le taux d'intérêt équivalent tel que défini dans l'Additif Technique Définitions Collateral.

<sup>35</sup> Si "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA" est applicable, toute référence à EONIA sera remplacée par une référence à "EONIA (Taux de Garantie)" tel que défini dans l'Additif Technique Définitions Collateral.

<sup>36</sup> Si les Conventions-Cadre Couvertes et les Documents de Transaction Couverte sont modifiés pour faire référence à EuroSTR (Taux de Garantie) au lieu de EONIA (Taux de Garantie), préciser " Non Applicable" et supprimer le reste du texte du présent paragraphe 3.2 ainsi que le sous-paragraphe 3.2.1, tout en conservant le titre du présent sous-paragraphe 3.2.

<sup>37</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

<sup>38</sup> Si les Parties ont intégré l'Additif Technique Définitions Collateral tel que modifié, avec "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux" ou "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA", alors toute référence à EONIA sera remplacée par "EONIA (Taux de Garantie)" en application des stipulations de l'Additif Technique Définitions Collateral, à la Date d'Effet de l'Avenant, même sans inclure le présent sous-paragraphe 3.2. Les Parties peuvent néanmoins souhaiter inclure le présent sous-paragraphe 3.2 si (a) elles souhaitent préciser une date différente à laquelle le remplacement de "EONIA" par "EONIA (Taux de Garantie)" doit prendre effet, (b) si les parties n'ont pas choisi d'appliquer "Remplacement du Taux d'Intérêt : Tous les Taux" ou "Remplacement du Taux d'Intérêt : EONIA", ou (c) pour des raisons de transparence accrue.

<sup>39</sup> Ce sous-paragraphe 3.2. concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe 3.2.1 tout en conservant le titre.

<sup>40</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

3.3. **Remplacement de l'EONIA dans les Contrats-cadre Couverts ou les Documents de Transaction Couverte avec EuroSTR (Taux de Garantie)**

**[Non Applicable]**<sup>41</sup>/A compter de la Date Pertinente<sup>42</sup> (incluse), toute référence à l'EONIA dans une Convention-Cadre Couverte ou un Document de Transaction Couverte sera remplacée par une référence à "EuroSTR (Taux de Garantie)".

3.3.1. **Période d'Application et Période d'Intérêt Rompues dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EuroSTR (Taux de Garantie).**

**[Non Applicable]**<sup>43</sup>/Si la Date Pertinente survient après le début d'une période d'application ou d'une période d'intérêt (quel que soit le terme utilisé) dans le cadre d'une Convention-Cadre Couverte ou un Document de Transaction Couverte (pour laquelle des montants seraient, en l'absence du présent Avenant, calculés par référence à l'EONIA), mais avant la fin de cette période d'application ou de cette période d'intérêt, le montant pour cette période d'application ou cette période d'intérêt sera déterminé en utilisant "EuroSTR (Taux de Garantie)", pour chaque jour pertinent de cette période qui survient **[après la Date Pertinente]** à compter du premier jour de cette période<sup>44</sup>.

**4. Indemnisation**

**[Non Applicable]**<sup>45</sup>/En considération des accords prévus par le présent Avenant, **[Partie [A][B]]** accepte de payer à Partie **[A][B]** **[insérer le montant]** le **[insérer la date]** **[les Parties]** conviennent d'effectuer le(s) paiement(s) notifié(s) et confirmé(s) par accord séparé en lien avec le présent Avenant **[avant le [date]]**.<sup>46</sup> **[Les Parties]** conviennent que cette obligation constitue une obligation de paiement pour les besoins de la Convention-Cadre Pertinente et que l'Article 7.1.1.1 de celle-ci s'appliquera à tout manquement à l'obligation de payer ce montant conformément au présent paragraphe 4 (*Indemnisation*).

**5. Déclarations**

5.1. **[Non Applicable]**<sup>47</sup>/Chaque Partie déclare à l'autre Partie que toutes les déclarations faites par cette Partie dans tout Document Couvert (tel que modifié par le présent Avenant) sont exactes et sincères sur tout point important à la Date d'Effet de l'Avenant.

5.2. Chaque partie réitère et confirme, à la date du présent Avenant et à la Date d'Effet de

<sup>41</sup> Si les Conventions-Cadre Couvertes et les Documents de Transaction Couverte sont modifiés pour faire référence à EONIA (Taux de Garantie) au lieu de EuroSTR (Taux de Garantie), préciser " Non Applicable" et supprimer le reste du texte du présent paragraphe 3.3 ainsi que le sous-paragraphe 3.3.1, tout en conservant le titre du présent sous-paragraphe 3.3.

<sup>42</sup> Se référer à la définition de la Date Pertinente au sous-paragraphe 7.2, pour laquelle un choix est requis.

<sup>43</sup> Ce sous-paragraphe 3.3.1 concerne les Périodes d'Application rompues et n'est pertinent que lorsque la Date Pertinente tombe en cours d'une Période d'Application. Si la mention "Non Applicable" est spécifiée, supprimer ce sous-paragraphe 3.3.1 tout en conservant le titre.

<sup>44</sup> La première alternative remplace l'EONIA seulement pour la période comprise entre la Date Pertinente et la fin de la Période d'Application. La seconde alternative remplace l'EONIA pour toute la Période d'Application.

<sup>45</sup> La question de savoir si une indemnisation doit être versée du fait de tout ou partie de ces modifications et le montant de cette indemnisation doit faire l'objet d'un accord des Parties. Si aucune indemnité n'est due, préciser "Non Applicable" et supprimer le reste du paragraphe 4 tout en conservant le titre.

<sup>46</sup> Les Parties peuvent souhaiter documenter cette indemnisation par accord séparé, en particulier si plusieurs accords sont modifiés ou si cet Avenant est conclu par un mandataire au nom de plusieurs clients.

<sup>47</sup> Si les parties ne répètent pas les déclarations faites dans tout Document Couvert qui est modifié par le biais du présent Avenant à la Date d'Effet de l'Avenant, préciser "Non Applicable" et supprimer le reste de ce sous-paragraphe 5.1.

l'Avenant, les déclarations et engagements effectués conformément à l'Article [6][6.1]<sup>48</sup> de la Convention-Cadre Pertinente. Toute référence faite à "la Convention" dans l'Article [6][6.1]<sup>49</sup> de la Convention-Cadre Pertinente sera lue comme étant une référence au présent Avenant.

## 6. Divers

6.1. **Définitions.** Toute référence à un Document Couvert sera lue comme étant une référence à ce Document Couvert tel que modifié par le présent Avenant, à compter de la Date d'Effet de l'Avenant.

6.2. **Interprétation.** Le présent Avenant complète, fait partie intégrante et est soumis aux stipulations de tout Document Couvert concerné. En cas de contradiction entre les présentes stipulations et celles d'un Document Couvert, les stipulations du présent Avenant prévaudront pour les seuls points dont il dispose.

6.3. **Absence de novation.** Il est précisé, en tant que de besoin, que le présent Avenant ne constitue en aucune manière une novation de tout Document Couvert. Les Parties conviennent qu'aucune stipulation d'un Document Couvert, ni aucun droit ou obligation des Parties en vertu d'un Document Couvert autre que ceux expressément visés par le présent Avenant n'est modifié, altéré ou diminué d'une quelconque manière par les présentes.

6.4. **Loi applicable.** Le présent Avenant [(et, dans la mesure permise, toute obligation non-contractuelle liée au présent Avenant ou en résultant)] est régi par le droit français.

6.5. **Attribution de compétence.** [Tout litige, relatif notamment à la validité, l'interprétation ou l'exécution du présent Avenant, sera soumis à la compétence des juridictions désignées compétentes en application de l'article 14 de la Convention-Cadre Pertinente.][Pour les besoins de tout litige, action, différend ou contestation découlant, se rapportant ou ayant un lien quelconque avec le présent Avenant, y compris tout différend quant à son existence, sa validité, son interprétation, son exécution, sa violation ou sa résiliation ou aux conséquences de sa nullité et tout différend relatif à une obligation non-contractuelle se rapportant ou ayant un lien avec le présent Avenant (une "**Procédure**"), chaque partie se soumet irrévocablement à la compétence exclusive du Tribunal de commerce de Paris (chambre internationale) et de la Cour d'appel de Paris [(chambre internationale)].]

[6.6. **Signature électronique.** Chaque Partie reconnaît et accepte qu'elle peut signer le présent Avenant par voie électronique. Chaque Partie déclare et garantit notamment qu'elle a le pouvoir de conclure cet Avenant par voie électronique et que ses documents constitutifs, les autorisations sociales, règles internes ou autres n'interdisent pas ce procédé de signature. Chaque Partie consent à ce que sa signature électronique apparaissant sur le document ait la même valeur qu'une signature manuelle. Elle consent également à ce que le recours à un procédé de signature électronique ait le même effet qu'une signature physique et que l'utilisation d'un procédé de signature électronique pour les besoins du présent Avenant ait la même validité et effet juridique que la signature physique et qu'elle est utilisée avec l'intention d'authentifier cet Avenant et de rapporter la preuve de l'intention de ladite Partie d'être liées par les termes et conditions prévues par les présentes. Pour les besoins du recours à un procédé de signature électronique, chaque

---

<sup>48</sup> Insérer l'Article 6.1 pour la version de 2013 de la Convention-Cadre AFB/FBF et l'Article 6 pour tout autre version de la Convention-Cadre AFB/FBF.

<sup>49</sup> Insérer l'Article 6.1 pour la version de 2013 de la Convention-Cadre AFB/FBF et l'Article 6 pour tout autre version de la Convention-Cadre AFB/FBF.

Partie autorise l'autre Partie à traiter des données personnelles relatives au signataire(s) pour les besoins de l'exécution du contrat et son intérêt légitime, notamment la gestion du contrat.<sup>50</sup>

6.7 **Originaux.** Le présent Avenant peut être signé et remis par chaque Partie sur des exemplaires distincts mais identiques (en ce compris par transmission par télécopie, système de messagerie électronique ou courrier électronique), et, ensemble, ils seront réputés constituer un exemplaire original.<sup>51</sup>

6.8 **Autres Stipulations**

[Non Applicable]<sup>52</sup>/[●]

## 7. Définitions

7.1. Les termes en majuscules utilisés dans le présent Avenant qui ne sont pas autrement définis auront la signification qui leur est donnée :

7.1.1. en ce qui concerne une Convention-Cadre Couverte, dans cette Convention-Cadre Couverte ;

7.1.2. en ce qui concerne une Transaction Couverte, dans le Document de Transaction Couverte de cette Transaction Couverte ; et

7.1.3. en ce qui concerne un Document de Garantie Couvert, dans ce Document de Garantie Couvert.

7.2. Aux fins du présent Avenant, les termes suivants auront la signification qui leur est donnée ci-après :

**Additif Technique Définitions Collateral** désigne, lorsque les Parties ont incorporé l'Additif Technique Définitions Collateral tel que modifié au paragraphe 2.1 (*Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral – Documents de Garantie Couverts*) ou au paragraphe 3.1 (*Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral – Conventions-Cadre Couvertes et Documents de Transaction Couverte*) du présent Avenant, cet additif technique tel que modifié, y compris toute version publiée ultérieurement et, lorsque les Parties ont incorporé l'Additif Technique Définitions Collateral par référence à une date de publication spécifique au paragraphe 2.1 (*Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral – Documents de Garantie Couverts*) ou au paragraphe 3.1 (*Incorporation de l'Additif Technique Définitions Collateral – Conventions-Cadre Couvertes et Documents de Transaction Couverte*) du présent Avenant, l'additif technique tel que publié à cette date.

**Annexe Remises en Garantie** désigne l'Annexe Remises en Garantie publiée par l'AFB en 1997 ou par la FBF en 2007 et conclue par les Parties aux présentes (directement ou par l'intermédiaire d'un tiers).

**Convention-cadre** désigne une Convention-cadre AFB/FBF qui a été conclue par une signature par les Parties (directement ou par l'intermédiaire d'un tiers) ou par la signature par les Parties (directement ou par l'intermédiaire d'un tiers) d'une confirmation qui intègre par référence une Convention-Cadre AFB/FBF.

**Convention-Cadre AFB/FBF** désigne une convention-cadre AFB relative aux opérations

<sup>50</sup> Les Parties sont invitées à faire leur propre évaluation de la validité et l'opposabilité de cette clause.

<sup>51</sup> A insérer les parties envisagent de signer par la technique du "counterpart".

<sup>52</sup> Si aucune autre stipulation n'est requise, préciser "Non Applicable".

de marché à terme publiée par l'Association française des banques (AFB) en 1994 ou une convention-cadre FBF relative aux opérations sur instruments financiers à terme publiée par la FBF en 2001, 2007 ou 2013, selon le cas.

**Convention-Cadre Couverte** désigne toute Convention-Cadre conclue entre les Parties qui n'est pas une Convention-Cadre Exclue par les Parties et pour laquelle, à compter de la Date de l'Effet de l'Avenant (incluse) et en l'absence du présent Avenant, un montant serait déterminé par référence à l'EONIA, sauf si :

- (i) le paragraphe 3.2 (*Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout contrat mentionné en Annexe II sous le titre "*F. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadres Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)*" ; ou
- (ii) le paragraphe 3.3 (*Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout contrat mentionné en Annexe II sous le titre "*G. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadres Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)*".

**Convention-Cadre Exclue par les Parties** désigne toute Convention-Cadre mentionnée comme telle dans l'Annexe I et toute Convention-Cadre qui prévoit par ses termes que ce document ne sera pas une Convention-Cadre Couverte pour les besoins du présent Avenant.

**Convention-Cadre Pertinente** désigne, pour toute modification apportée à un Document Couvert, la Convention-Cadre (ou son équivalent, y compris toute Convention-Cadre incorporée par référence) à laquelle ce Document Couvert se rapporte ou, si le Document Couvert est une Convention-Cadre, cette Convention-Cadre.

**[Date de Cessation** désigne la dernière date à laquelle l'*euro overnight index average* est fourni par l'European Money Markets Institute en tant qu'administrateur de l'indice de référence (ou tout administrateur successeur de l'*euro overnight index average*) sur le Site Internet de l'EMMI.]<sup>53</sup>

**Date d'Effet de l'Avenant** désigne [la date de cet Avenant] [●].<sup>54</sup>

**Date Pertinente** désigne :

- (i) concernant tout Document de Garantie Couvert, [la Date d'Effet de l'Avenant] [le

<sup>53</sup> Supprimer cette définition si elle n'est pas utilisée dans la définition de la Date Pertinente.

<sup>54</sup> Insérer ici une autre date si les Parties souhaitent que les modifications prévues par le présent Avenant prennent effet à une date autre que la date de signature du présent Avenant.

premier Jour de Règlement TARGET suivant la Date de Cessation<sup>55</sup>/<sup>56</sup> ;

- (ii) concernant tout Document de Transaction Couverte, la [la Date d'Effet de l'Avenant]/[le premier Jour de Règlement TARGET suivant la Date de Cessation]<sup>57</sup>/<sup>58</sup> ;<sup>58</sup> et
- (iii) concernant toute Convention-Cadre Couverte, la [la Date d'Effet de l'Avenant]/[le premier Jour de Règlement TARGET suivant la Date de Cessation]<sup>59</sup>/<sup>60</sup> ;<sup>60</sup>

**Document Couvert** désigne, selon le cas, toute Convention-Cadre Couverte, tout Document de Garantie Couvert et tout Document de Transaction Couverte.

**Document de Garantie Couvert** désigne, à l'exception d'un Document de Garantie Exclu par les Parties, les documents suivants :

- (a) toute Annexe Remises en Garantie ; et
- (b) tout Addendum AFB/BBF au Document Annexe de Remise en Garantie pour la Marge Variable (MV) ISDA 2016 ;

dans chaque cas, pour lequel, en l'absence du présent Avenant, un montant serait déterminé par référence à l'EONIA à compter de la Date d'Effet de l'Avenant (incluse), sauf si le paragraphe 2 (*Modification de l'EONIA en tant que Taux de Référence ou Taux d'Intérêt (MV) dans les Document de Garantie Couverts*) s'applique et que, pour les besoins de cette

---

<sup>55</sup> Les Parties peuvent souhaiter inclure cette deuxième possibilité si la modification est effectuée à proximité de la Date de Cessation ou peu après, auquel cas les Parties doivent envisager d'inclure les sous-paragraphes 1.2.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 1.3.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 2.2.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EONIA (Taux de Garantie)*), 2.3.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EuroSTR (Taux de Garantie)*), 3.2.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EONIA (Taux de Garantie)*) et 3.3.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EuroSTR (Taux de Garantie)*).

<sup>56</sup> Les Parties peuvent définir la "Date Pertinente", c'est-à-dire la date à partir de laquelle la modification du taux d'intérêt dans le Document de Garantie Couvert pertinent s'appliquera.

<sup>57</sup> Les Parties peuvent souhaiter inclure cette deuxième possibilité si la modification est effectuée à proximité de la Date de Cessation ou peu après, auquel cas les Parties doivent envisager d'inclure les sous-paragraphes 1.2.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 1.3.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 2.2.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EONIA (Taux de Garantie)*), 2.3.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EuroSTR (Taux de Garantie)*), 3.2.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EONIA (Taux de Garantie)*) et 3.3.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EuroSTR (Taux de Garantie)*).

<sup>58</sup> Les Parties peuvent définir la "Date Pertinente", c'est-à-dire la date à partir de laquelle la modification du taux Variable ou taux d'intérêt (selon le cas) pour les besoins du Document de Transactions Couverte pertinent s'appliquera.

<sup>59</sup> Les Parties peuvent souhaiter inclure cette deuxième possibilité si la modification est effectuée à proximité de la Date de Cessation ou peu après, auquel cas les Parties doivent envisager d'inclure les sous-paragraphes 1.2.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 1.3.2 (*Périodes d'Application Rompues dans tout Document de Transaction Couverte*), 2.2.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EONIA (Taux de Garantie)*), 2.3.1 (*Périodes d'Intérêts Rompues dans les Documents de Garantie Couverts - EuroSTR (Taux de Garantie)*), 3.2.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EONIA (Taux de Garantie)*) et 3.3.1 (*Périodes d'Application et Périodes d'Intérêt Rompues dans les Conventions- cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte - EuroSTR (Taux de Garantie)*).

<sup>60</sup> Les Parties peuvent définir la "Date Pertinente", c'est-à-dire la date à partir de laquelle la modification du taux d'intérêt dans la Convention-Cadre pertinente s'appliquera.

clause, le paragraphe "Documents Spécifiquement Couverts" est applicable, auquel cas, pour les besoins (i) du paragraphe 2.2 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)*), ou (ii) du paragraphe 2.3 (*Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)*), selon le paragraphe applicable, cela désigne tout contrat mentionné en Annexe II sous le titre "D. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)" ou sous le titre "E. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)", selon le cas.

**Document de Garantie Exclu par les Parties** désigne tout document de garantie mentionné comme tel dans l'Annexe I et tout document de garantie qui prévoit par ses termes que ce document ne sera pas un Document de Garantie Couvert pour les besoins du présent Avenant.

**Document de Transaction Couverte** désigne, pour toute Transaction Couverte, chaque document ou autre élément de preuve échangé entre les Parties, signé par un mécanisme électronique de rapprochement ou d'affirmation, ou autrement en vigueur, qui, pris ensemble, confirment les termes de cette Transaction Couverte, sauf si :

- (i) le paragraphe 1.1 (*Mise à jour de la définition de l'EONIA pour les besoins du Taux Variable EONIA*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout document mentionné en Annexe II sous le titre "A. Mise à jour de la définition de l'EONIA pour les besoins du Taux Variable EONIA" ;
- (ii) le paragraphe 1.2 (*Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout document mentionné en Annexe II sous le titre "B. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR" ;
- (iii) le paragraphe 1.3 (*Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout document mentionné en Annexe II sous le titre "C. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR plus une marge de 8,5 points de base" ;
- (iv) le Paragraphe 3.2 (*Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout document mentionné en Annexe II sous le titre "F. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadres Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)"; ou
- (v) le Paragraphe 3.3 (*Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadres Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe uniquement, cela désigne tout document mentionné en Annexe II sous le titre "G. Remplacement

*de l'EONIA dans les Conventions-Cadres Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)" ;*

**EONIA** désigne l'euro overnight index average fourni par l'European Money Markets Institute (EMMI) en tant qu'administrateur de l'indice de référence (ou tout administrateur successeur de l'euro overnight index average) sur le Site Internet de l'EMMI, et une référence à l'EONIA dans tout Document de Transaction Couverte ou Document de Garantie Couvert signifie toute référence à l'EONIA, quelle que soit sa description.

**EONIA (Taux de Garantie)** a la signification qui lui est donnée dans l'Additif Technique Définitions Collateral.

**EuroSTR (Taux de Garantie)** a la signification qui lui est donnée dans l'Additif Technique Définitions Collateral.

**Jour de Règlement TARGET** désigne tout jour où TARGET2 (le système de transferts express automatisés transeuropéens à règlement brut en temps réel) (ou tout système de transfert qui lui succède) est ouvert pour le règlement de paiements en euros.

**Recueil de Taux 2021** désigne l'Additif Technique "Recueil de Taux 2021" publié par la FBF en 2021

**Site Internet de l'EMMI** a la signification qui lui est donnée dans l'Additif Technique Définitions Collateral.

**Transaction Couverte** désigne toute transaction conclue entre les Parties qui complète, fait partie et est soumise à une Convention-Cadre et n'est pas une Transaction Exclue par les Parties et pour laquelle, à compter de la Date d'Effet de l'Avenant (incluse) et en l'absence du présent Avenant, un montant serait déterminé par référence à l'EONIA, sauf si :

- (i) le paragraphe 1.2 (*Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe, cela désigne tout contrat mentionné en Annexe II sous le titre "*B. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR*" ; ou
- (ii) le Paragraphe 1.3 (*Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR majoré de 0,085%*) s'applique et que le paragraphe "Documents Couverts Spécifiés" est applicable, auquel cas, pour les besoins de ce paragraphe, cela désigne tout contrat mentionné en Annexe II sous le titre "*C. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR majoré de 0,085%*".

**Transaction Exclue par les Parties** désigne toute transaction mentionnée comme telle dans l'Annexe I et toute transaction dont les Parties sont convenues, par une stipulation expresse dans un Document de Transaction Couverte, qu'elle ne constituera pas une Transaction Couverte pour les besoins du présent Avenant.

EN FOI DE QUOI, les Parties ont signé le présent Avenant aux dates respectives indiquées ci-dessous, avec effet à la Date d'Effet de l'Avenant.<sup>61</sup>

.....

(Nom de la Partie)

.....

(Nom de la Partie)

Par : .....

Par : .....

Nom :

Nom :

Titre :

Titre :

Date :

Date :

---

<sup>61</sup> Les Parties doivent adapter les blocs de signature selon les besoins.

## Annexe I

### **Conventions-Cadre Exclues par les Parties, Documents de Garantie Exclues par les Parties, Transactions Exclues par les Parties**

#### **A. Conventions-Cadre Exclues par les Parties**

**[Non Applicable]**/

**[•]**

#### **B. Documents de Garantie Exclues par les Parties**

**[Non Applicable]**/

**[•]**

#### **C. Transactions Exclues par les Parties**

**[Non Applicable]**/

**[•]**

## Annexe II

### Documents Couverts Spécifiés

**A. Mise à jour de la définition de l'EONIA pour les besoins du Taux Variable EONIA**

**Documents Couverts Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

**[•]**

**B. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR**

**Documents Couverts Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

**[•]**

**C. Remplacement du Taux Variable EONIA par le Taux Variable EuroSTR majoré de 0,085%**

**Documents Couverts Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

**[•]**

**D. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EONIA (Taux de Garantie)**

**Documents Couverts Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

**[•]**

**E. Remplacement de l'EONIA dans les Documents de Garantie Couverts par EuroSTR (Taux de Garantie)**

**Documents Couverts Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

**[•]**

**F. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EONIA (Taux de Garantie)**

**Conventions-Cadre Couvertes Spécifiés :**

*[Non Applicable]*

[•]

**Documents de Transaction Couverte Spécifiés :**

[*Non Applicable*]

[•]

**G. Remplacement de l'EONIA dans les Conventions-Cadre Couvertes ou les Documents de Transaction Couverte par EuroSTR (Taux de Garantie)**

**Conventions-Cadre Couvertes Spécifiés :**

[*Non Applicable*]

[•]

**Documents de Transaction Couverte Spécifiés :**

[*Non Applicable*]

[•]