

II

(Actes non législatifs)

RÈGLEMENTS

RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2016/378 DE LA COMMISSION

du 11 mars 2016

définissant des normes techniques d'exécution concernant la date, le format et le modèle de présentation des notifications à adresser aux autorités compétentes conformément au règlement (UE) n° 596/2014 du Parlement européen et du Conseil

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le traité sur le fonctionnement de l'Union européenne,

vu le règlement (UE) n° 596/2014 du Parlement européen et du Conseil du 16 avril 2014 sur les abus de marché (règlement relatif aux abus de marché) et abrogeant la directive 2003/6/CE du Parlement européen et du Conseil et les directives 2003/124/CE, 2003/125/CE et 2004/72/CE de la Commission ⁽¹⁾, et en particulier son article 4, paragraphe 5, troisième alinéa,

considérant ce qui suit:

- (1) Afin de garantir la cohérence des obligations déclaratives et de réduire les contraintes administratives pour les entités soumises à ces obligations, il convient d'aligner les obligations déclaratives prévues par le présent règlement avec celles prévues par le règlement délégué de la Commission devant être adopté en vertu de l'article 27, paragraphe 3, troisième alinéa, du règlement délégué (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil ⁽²⁾.
- (2) Afin d'être en mesure, dans un souci d'intégrité du marché, de garantir la qualité des données et l'efficacité de la surveillance du marché, les autorités compétentes et l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF) devraient pouvoir recevoir rapidement des notifications complètes pour chaque journée de négociation.
- (3) En vue de permettre l'utilisation efficace et efficiente des données par les autorités compétentes, il convient de veiller à la cohérence des modèles et des formats utilisés pour les notifications d'instruments financiers. Le respect, en ce qui concerne les informations détaillées à fournir dans ces notifications, des normes internationales applicables sert ces objectifs.
- (4) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'AEMF.
- (5) L'AEMF a procédé à des consultations publiques ouvertes sur le projet de norme technique d'exécution sur lequel se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels connexes et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ⁽³⁾.
- (6) Afin de garantir le bon fonctionnement des marchés financiers, il convient que le présent règlement entre en vigueur d'urgence et que ses dispositions s'appliquent à compter de la même date que celles du règlement (UE) n° 596/2014,

⁽¹⁾ JO L 173 du 12.6.2014, p. 1.

⁽²⁾ Règlement délégué (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 (JO L 173 du 12.6.2014, p. 84).

⁽³⁾ Règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers), modifiant la décision n° 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

1. Chaque jour où elle est ouverte à la négociation, et au plus tard à 21 heures (HEC), une plate-forme de négociation notifie à son autorité compétente conformément à l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 596/2014, au moyen de processus automatisés, tous les instruments financiers qui, avant 18 heures (HEC) le même jour, ont, pour la première fois, fait l'objet d'une demande d'admission à la négociation, ou été admis à la négociation, ou négociés sur cette plate-forme de négociation — y compris lorsque des ordres ont été placés ou des prix proposés par l'intermédiaire de son système —, ou ont cessé d'être négociés ou admis à la négociation sur cette plate-forme.
2. Les instruments financiers qui, après 18 heures (HEC), ont, pour la première fois, fait l'objet d'une demande d'admission à la négociation, ou été admis à la négociation, ou négociés sur la plate-forme de négociation — y compris lorsque des ordres ont été placés ou des prix proposés par l'intermédiaire de son système —, ou ont cessé d'être négociés ou admis à la négociation sur cette plate-forme sont notifiés par celle-ci à l'autorité compétente, au moyen de processus automatisés, au plus tard à 21 heures (HEC) le jour suivant d'ouverture à la négociation de la plate-forme.
3. Chaque jour, au plus tard à 23 h 59 (HEC), les autorités compétentes transmettent à l'AEMF, conformément à l'article 4, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 596/2014, les notifications visées aux paragraphes 1 et 2, au moyen de processus automatisés et en utilisant les canaux de communication électronique sécurisés qui les relient à l'AEMF.

Article 2

Toutes les informations détaillées à inclure dans les notifications adressées conformément à l'article 4, paragraphes 1 et 2, du règlement (UE) n° 596/2014 sont présentées conformément aux normes et formats spécifiés à l'annexe du présent règlement, sous une forme électronique lisible par machine et selon un modèle XML commun conforme à la méthodologie ISO 20022.

Article 3

Le présent règlement entre en vigueur le jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Il s'applique à compter du 3 juillet 2016.

Le présent règlement est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 11 mars 2016.

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXES

**Normes et formats de présentation des notifications à adresser aux autorités compétentes
conformément au règlement (UE) n° 596/2014**

Tableau 1

Légende du tableau 3

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{ALPHANUM-n}	Jusqu'à <i>n</i> caractères alphanumériques	Champ permettant d'introduire un texte à contenu libre
{CFI_CODE}	6 caractères	Code ISO 10962 CFI.
{COUNTRYCODE_2}	2 caractères alphanumériques	Code pays à 2 lettres (code pays ISO 3166-1 alpha-2).
{CURRENCYCODE_3}	3 caractères alphanumériques	Code monnaie à 3 lettres (code monnaie ISO 4217).
{DATE_TIME_FORMAT}	Format de date et heure ISO 8601	<ul style="list-style-type: none"> — Date et heure selon le format suivant: — AAAAMMJJThh:mm:ss.dddZ. — «AAAA» correspond à l'année, — «MM» au mois, — «JJ» au jour, — «T» signifie que la lettre «T» doit être utilisée pour introduire l'heure, — «hh» correspond à l'heure, — «mm» aux minutes, — «ss.dddZ» aux secondes et aux fractions de secondes, — «Z» correspond à l'heure TUC. Dates et heures doivent être déclarées en TUC.
{DATEFORMAT}	Format de date ISO 8601	Les dates doivent respecter le format: AAAA-MM-JJ.
{DECIMAL-n/m}	Nombre décimal de maximum <i>n</i> chiffres au total dont <i>m</i> chiffres maximum peuvent être des chiffres de fractions	Champ numérique pouvant contenir des valeurs positives ou négatives. <ul style="list-style-type: none"> — utiliser comme séparateur décimal le signe «.» (point), — faire précéder les valeurs négatives du signe «-» (moins), Indiquer des valeurs arrondies et non tronquées.

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{INDEX}	4 caractères alphabétiques	«EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP «EURI» — EURIBOR «EUUS» — EURODOLLAR «EUCH» — EuroSwiss «GCFR» — GCF REPO «ISDA» — ISDAFIX «LIBI» — LIBID «LIBO» — LIBOR «MAAA» — Muni AAA «PFAN» — Pfandbriefe «TIBO» — TIBOR «STBO» — STIBOR «BBSW» — BBSW «JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR «CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — Trésor «SWAP» — Contrats d'échange «FUSW» — Contrats d'échange à terme <i>(future SWAPS)</i>
{INTEGER-n}	Nombre entier de <i>n</i> chiffres au maximum	Champ numérique pouvant contenir des entiers positifs ou négatifs.
{ISIN}	12 caractères alphanumériques	Code ISIN au sens de la norme ISO 6166.
{LEI}	20 caractères alphanumériques	Identifiant de l'entité juridique au sens de la norme ISO 17442.
{MIC}	4 caractères alphanumériques	Identifiant de marché au sens de la norme ISO 10383.
{FISN}	35 caractères alphanumériques	Code FISN au sens de la norme ISO 18774.

Tableau 2

**Classification des instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission pour le tableau 3
(champs 35 à 37)**

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
«AGRI» — Agricole	«GROS» — Grains et oléagineux	«FWHT» — Blé fourrager «SOYB» — Graines de soja «CORN» — Maïs «RPSD» — Colza «RICE» — Riz «OTHR» — Autres
	«SOFT» — Produits non durables	«CCOA» — Cacao «ROBU» — Café robusta «WHSG» — Sucre blanc «BRWN» — Sucre brut «OTHR» — Autres
	«POTA» — Pomme de terre	
	«OOLI» — Huile d'olive	«LAMP» — Huile d'olive lampante
	«DIRY» — Produits laitiers	
	«FRST» — Produits sylvicoles	
	«SEAF» — Produits de la mer	
	«LSTK» — Bétail	
	«GRIN» — Céréales	«MWHT» — Blé meunier
«NRGY» — Énergie	«ELEC» — Électricité	«BSLD» — Charge de base «FITR» — Droits financiers de transport «PKLD» — Charge de pointe «OFFP» — Hors période de pointe «OTHR» — Autres
	«NGAS» — Gaz naturel	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — Gaz naturel liquéfié (GNL) «NBPG» — National Balancing Point (NBP) «NCGG» — NetConnect Germany (NCG) «TTFG» — Title Transfer Facility (TTF)

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
	«OILP» — Pétrole	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CND» — Canadian «COND» — Condensats «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubaï «ESPO» — ESPO «ETHA» — Éthanol «FUEL» — Fioul «FOIL» — Mazout «GOIL» — Gasoil «GSLN» — Essence «HEAT» — Mazout de chauffage «JTFL» — Carburéacteurs «KERO» — Kérosène «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — MARS «NAPH» — Naphtha «NGLO» — Liquides de gaz naturel (LGN) «TAPI» — Tapis «URAL» — Urals «WTIO» — West Texas Intermediate (WTI)
	«COAL» — Charbon «INRG» — Interénergies «RNNG» — Énergies renouvelables «LGHT» — Fractions légères «DIST» — Distillats	
«ENVR» — Environnement	«EMIS» — Émissions	«CERE» — Unités de réduction certifiée des émissions (URCE) «ERUE» — Unités de réduction des émissions (URE) «EUA» — Quotas d'émission UE «EUAA» — Quotas du secteur de l'aviation UE «OTHR» — Autres
	«WTHR» — Climatique «CRBR» — Carbone	

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
«FRGT» — Fret	«WETF» — Vrac liquide	«TNKR» — Navires citernes
	«DRYF» — Vrac solide	«DBCR» — Vraquiers
	«CSHP» — Navires porte-conteneurs	
«FRTL» — Engrais	«AMMO» — Ammoniac «DAPH» — Phosphate diammonique «PTSH» — Potasse «SLPH» — Soufre «UREA» — Urée «UAAN» — Urée et nitrate d'ammonium	
«INDP» — Produits industriels	«CSTR» — Construction «MFTG» — Fabrication	
«METL» — Métaux	«NPRM» — Non précieux	«ALUM» — Aluminium «ALUA» — Alliage d'aluminium «CBLT» — Cobalt «COPR» — Cuivre «IRON» — Minerai de fer «LEAD» — Plomb «MOLY» — Molybdène «NASC» — North American Special Aluminium Alloy Contract (NASAAC) «NICK» — Nickel «STEL» — Acier «TINN» — Étain «ZINC» — Zinc «OTHR» — Autres
	«PRME» — Précieux	«GOLD» — Or «SLVR» — Argent «PTNM» — Platine «PLDM» — Palladium «OTHR» — Autres
«MCEX» — Exotiques multiproduits		
«PAPR» — Papier	«CBRD» — Papier pour carton ondulé «NSPT» — Papier journal «PULP» — Pâte à papier «RCVP» — Papier recyclé	

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
«POLY» — Polypropylène	«PLST» — Plastiques	
«INFL» — Inflation		
«OEST» — Statistiques économiques officielles		
«OTHC» — Autres C10 au sens du tableau 10.1, section 10, de l'annexe III du règlement délégué de la Commission complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation relatives aux obligations de transparence applicables aux plates-formes de négociation et aux entreprises d'investissement pour les obligations, produits financiers structurés, quotas d'émission et instruments dérivés.	«DLVR» — Livrables «NDLV» — Non livrables	
«OTHR» — Autres		

Tableau 3

Normes et formats à respecter pour les notifications imposées par l'article 4, paragraphes 1 et 2 du règlement (UE) n° 596/2014

N°	CHAMP	NORMES ET FORMATS À RESPECTER DANS LES DÉCLARATIONS
Champs généraux		
1	Code d'identification de l'instrument	{ISIN}
2	Nom complet de l'instrument	{ALPHANUM-350}
3	Classement de l'instrument	{CFI_CODE}
4	Indicateur d'instruments dérivés sur matières premières	«true» — Oui «false» — Non
Champs concernant l'émetteur		
5	Identifiant de l'émetteur ou de l'opérateur de la plate-forme de négociation	{LEI}
Champs concernant la plate-forme de négociation		
6	Plate-forme de négociation	{MIC}
7	Nom abrégé de l'instrument financier	{FISN}
8	Demande d'admission à la négociation introduite par l'émetteur	«true» — Oui «false» — Non

N°	CHAMP	NORMES ET FORMATS À RESPECTER DANS LES DÉCLARATIONS
9	Date d'approbation de l'admission à la négociation	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Date de la demande d'admission à la négociation	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Date d'admission à la négociation ou date de la première négociation	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Date de cessation	{DATE_TIME_FORMAT}
Champs concernant le notionnel		
13	Monnaie du notionnel 1	{CURRENCYCODE_3}
Champs concernant les obligations ou autres titres de créance		
14	Montant nominal émis total	{DECIMAL-18/5}
15	Date d'échéance	{DATEFORMAT}
16	Monnaie de la valeur nominale	{CURRENCYCODE_3}
17	Valeur nominale unitaire/valeur négociée minimale	{DECIMAL-18/5}
18	Taux fixe	{DECIMAL-11/10} En pourcentage (ex: 7.0 = 7 % et 0.3 = 0,3 %)
19	Identifiant de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	{ISIN}
20	Nom de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — Si l'indice ne figure pas sur la liste {INDEX}
21	Durée de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	{INTEGER-3}+ «DAYS» — jours {INTEGER-3}+ «WEEK» — semaines {INTEGER-3}+ «MNTH» — mois {INTEGER-3}+ «YEAR» — années
22	Écart en points de base de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	{INTEGER-5}
23	Rang de l'obligation	«SNDB» — Dette de premier rang (senior) «MZZD» — Dette mezzanine «SBOD» — Dette subordonnée «JUND» — Dette de rang inférieur (junior)

N°	CHAMP	NORMES ET FORMATS À RESPECTER DANS LES DÉCLARATIONS
Champs concernant les instruments dérivés et les instruments dérivés titrisés		
24	Date d'expiration	{DATEFORMAT}
25	Multiplicateur du prix	{DECIMAL-18/17}
26	Code de l'instrument sous-jacent	{ISIN}
27	Émetteur du sous-jacent	{LEI}
28	Nom de l'indice sous-jacent	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — Si l'indice ne figure pas sur la liste {INDEX}
29	Durée de l'indice sous-jacent	{INTEGER-3}+ «DAYS» — jours {INTEGER-3}+«WEEK» — semaines {INTEGER-3}+ «MNTH» — mois {INTEGER-3}+ «YEAR» — années
30	Type d'option	«PUTO» — Vente «CALL» — Achat «OTHER» — Si la nature de l'option (achat ou vente) ne peut être établie
31	Prix d'exercice	{DECIMAL-18/13} si le prix est exprimé en valeur monétaire {DECIMAL-11/10} si le prix est exprimé en pourcentage ou en taux de rendement {DECIMAL-18/17} si le prix est exprimé en points de base «PNDG» si le prix n'est pas disponible
32	Monnaie du prix d'exercice	{CURRENCYCODE_3}
33	Modalités d'exercice de l'option	«EURO» — Option de type européen «AMER» — Option de type américain «ASIA» — Option de type asiatique «BERM» — Option de type bermudien «OTHR» — Tout autre type d'option
34	Modalités de livraison	«PHYS» — règlement physique «CASH» — règlement en numéraire «OPTN» — Optionnel pour la contrepartie ou décidé par un tiers

N°	CHAMP	NORMES ET FORMATS À RESPECTER DANS LES DÉCLARATIONS
Instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission		
35	Catégories de produits	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières et sur quotas d'émissions.
36	Sous-catégories de produits	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Sous-catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières et sur quotas d'émissions.
37	Produits	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières et sur quotas d'émissions.
38	Type de transaction	«FUTR» — Contrats à terme «OPTN» — Options «TAPO» — TAPOS «SWAP» — Contrats d'échange «MINI» — Minis «OTCT» — De gré à gré «ORIT» — Outright «CRCK» — Crack «DIFF» — Différentiel «OTHR» — Autres
39	Type de prix final	«ARGM» — Argus/McCloskey «BLTC» — Baltic «EXOF» — Exchange «GBCL» — GlobalCOAL «IHSM» — IHS McCloskey «PLAT» — Platts «OTHR» — Autres

Dérivés sur taux d'intérêt

— Les champs de cette section ne concernent que les instruments ayant pour sous-jacent un instrument non financier sur taux d'intérêt.

40	Taux de référence	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — Si l'indice ne figure pas sur la liste {INDEX}
----	-------------------	---

N°	CHAMP	NORMES ET FORMATS À RESPECTER DANS LES DÉCLARATIONS
41	Durée du contrat (taux d'intérêt)	{INTEGER-3}+ «DAYS» — jours {INTEGER-3}+ «WEEK» — semaines {INTEGER-3}+ «MNTH» — mois {INTEGER-3}+ «YEAR» — années
42	Monnaie du notionnel 2	{CURRENCYCODE_3}
43	Taux fixe de la jambe 1	{DECIMAL-11/10} En pourcentage (ex: 7.0 = 7 % et 0.3 = 0,3 %)
44	Taux fixe de la jambe 2	{DECIMAL-11/10} En pourcentage (ex: 7.0 = 7 % et 0.3 = 0,3 %)
45	Taux variable de la jambe 2	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — Si l'indice ne fi- gure pas sur la liste {INDEX}
46	Durée de la jambe 2 du contrat (taux d'intérêt)	{INTEGER-3}+ «DAYS» — jours {INTEGER-3}+ «WEEK» — semaines {INTEGER-3}+ «MNTH» — mois {INTEGER-3}+ «YEAR» — années

Dérivés de change

— Les champs de cette section doivent uniquement être remplis pour les instruments ayant pour sous-jacent un instru-
ment non financier de change.

47	Monnaie du notionnel 2	{CURRENCYCODE_3}
48	Type de change	«FXCR» — Cours croisés «FXEM» — Marchés des changes émer- gents «FXMJ» — Majors