

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2017/585 DE LA COMMISSION**du 14 juillet 2016****complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant les normes et formats de données à respecter pour les données de référence relatives aux instruments financiers et les mesures techniques liées aux dispositions à prendre par l'Autorité européenne des marchés financiers et les autorités compétentes****(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°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 ⁽¹⁾, et notamment son article 27, paragraphe 3, troisième alinéa,

considérant ce qui suit:

- (1) Afin de permettre aux autorités compétentes de surveiller efficacement le marché, les données de référence relatives aux instruments financiers doivent être communiquées dans un format cohérent et selon des normes uniformes.
- (2) La communication et la publication des données de référence sous une forme électronique, lisible par machine et téléchargeable facilitent l'utilisation et l'échange efficaces de ces données.
- (3) La réception rapide des données de référence concernant tous les instruments financiers qui sont admis à la négociation ou négociés sur une plate-forme de négociation ou par l'intermédiaire d'un internalisateur systématique permet aux autorités compétentes et à l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF) de garantir la qualité des données et l'efficacité de la surveillance du marché, et de contribuer ainsi à l'intégrité du marché.
- (4) Afin de veiller à ce que les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques présentent des données de référence complètes et exactes et que les autorités compétentes soient à même de recevoir et d'utiliser efficacement ces données en temps utile, il convient de fixer des délais de soumission appropriés. Un délai suffisant doit être prévu pour détecter les omissions ou les inexactitudes dans les données avant leur publication. Afin de garantir que les données de référence transmises sont cohérentes avec les informations correspondantes communiquées conformément à l'article 26 du règlement (UE) n° 600/2014, les autorités compétentes doivent utiliser les données de référence se rapportant à un jour donné pour valider et échanger les déclarations de transactions exécutées ce même jour.
- (5) Conformément à l'article 27, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014, les expéditeurs et les destinataires des données de référence doivent assurer la réception effective, l'échange efficace et la qualité des données, ainsi que leur cohérence avec les déclarations de transactions visées à l'article 26 dudit règlement. Les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques doivent donc fournir des données de référence complètes et exactes et informer rapidement les autorités compétentes de toute omission ou inexactitude constatée dans les données déjà transmises. Ils doivent également maintenir des systèmes et des contrôles adéquats pour garantir l'exactitude, l'exhaustivité et la fourniture en temps utile des données de référence.
- (6) Aux fins de l'utilisation et de l'échange efficaces des données de référence, et afin de veiller à leur cohérence avec les données correspondantes fournies dans les déclarations de transactions, les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques doivent identifier les instruments financiers et les entités juridiques à inclure dans les données de référence en se fondant sur des normes uniformes reconnues. En particulier, et afin de garantir que les données de référence sont appariées avec les déclarations de transactions correspondantes, les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques doivent veiller à obtenir et à inclure dans les données déclarées les codes ISIN (International Securities Identifying Number), conformes à l'ISO 6166, concernant les instruments financiers communiqués.
- (7) Par souci de cohérence et afin d'assurer le bon fonctionnement des marchés financiers, il convient que les dispositions prévues par le présent règlement et celles prévues par le règlement (UE) n° 600/2014 s'appliquent à compter de la même date.

⁽¹⁾ JO L 173 du 12.6.2014, p. 84.

- (8) Le présent règlement est fondé sur les projets de normes techniques de réglementation soumis à la Commission par l'AEMF.
- (9) L'AEMF a procédé à des consultations publiques ouvertes sur les projets de normes techniques de réglementation sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels connexes et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Contenu, normes, forme et format des données de référence

Les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques communiquent aux autorités compétentes les données de référence détaillées relatives aux instruments financiers («données de référence») qui sont visées dans le tableau 3 de l'annexe et se rapportent à l'instrument financier concerné. Toutes les informations détaillées sont présentées conformément aux normes et formats spécifiés dans le tableau 3 de l'annexe, sous une forme électronique lisible par machine et selon un modèle XML commun conforme à la méthodologie ISO 20022.

Article 2

Délais de communication des données de référence aux autorités compétentes

1. Chaque jour où ils sont ouverts à la négociation, les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques communiquent à leur autorité compétente, avant 21h00 (HEC), les données de référence relatives à tous les instruments financiers qui ont été admis à la négociation ou négociés avant 18h00 le même jour, y compris lorsque des ordres ont été placés ou des prix proposés par l'intermédiaire de leur système.
2. Lorsqu'un instrument financier a été admis à la négociation ou négocié, y compris lorsqu'un ordre a été placé ou un prix proposé pour la première fois, après 18h00 (HEC) un jour où une plate-forme de négociation ou un internalisateur systématique est ouvert à la négociation, les données de référence relatives à l'instrument financier concerné sont communiquées avant 21h00 (HEC) le jour suivant d'ouverture à la négociation de la plate-forme ou de l'internalisateur systématique en question.

Article 3

Identification des instruments financiers et des entités juridiques

1. Avant le début de la négociation d'un instrument financier sur une plate-forme de négociation ou un internalisateur systématique, la plate-forme de négociation ou l'internalisateur systématique concerné obtient le code ISIN (International Securities Identifying Number) conforme à l'ISO 6166 pour l'instrument financier.
2. Les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques s'assurent que les identifiants de l'entité juridique inclus dans les données de référence communiquées sont conformes à la norme ISO 17442:2012, ont trait à l'émetteur concerné et figurent dans la base de données des identifiants internationaux pour les entités juridiques, qui est gérée par l'unité opérationnelle centrale désignée par le Comité de surveillance réglementaire du système d'identifiant international pour les entités juridiques.

Article 4

Dispositions visant à garantir la réception effective des données de référence

1. Les autorités compétentes contrôlent et évaluent l'exhaustivité des données de référence reçues d'une plate-forme de négociation ou d'un internalisateur systématique, ainsi que la conformité de ces données avec les normes et formats spécifiés dans le tableau 3 de l'annexe.

⁽¹⁾ 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).

2. À la suite de la réception des données de référence pour chaque jour où les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques sont ouverts à la négociation, les autorités compétentes informent les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques de toute omission dans les données et de tout manquement à l'obligation de fournir les données de référence dans les délais fixés à l'article 2.
3. L'AEMF contrôle et évalue l'exhaustivité des données de référence reçues des autorités compétentes, ainsi que la conformité de ces données avec les normes et formats spécifiés dans le tableau 3 de l'annexe.
4. À la suite de la réception des données de référence transmises par les autorités compétentes, l'AEMF les informe de toute omission dans les données et de tout manquement à l'obligation de fournir les données de référence dans les délais fixés à l'article 7, paragraphe 1.

Article 5

Dispositions visant à garantir la qualité des données de référence

Au moins une fois par trimestre, les autorités compétentes procèdent à des évaluations de la qualité en ce qui concerne le contenu et l'exactitude des données de référence reçues conformément à l'article 27, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 600/2014.

Article 6

Méthodes et modalités de communication des données de référence

1. Les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques veillent à fournir des données de référence complètes et exactes à leurs autorités compétentes conformément à l'article 1^{er} et à l'article 3.
2. Les plates-formes de négociation et les internalisateurs systématiques mettent en place des méthodes et des modalités qui leur permettent de détecter les données de référence incomplètes ou inexactes déjà transmises. Une plate-forme de négociation ou un internalisateur systématique qui constate que des données de référence communiquées sont incomplètes ou inexactes le notifie sans délai à son autorité compétente, à laquelle il transmet dans les meilleurs délais les données de référence complètes et exactes correspondantes.

Article 7

Dispositions visant à garantir l'échange efficace et la publication des données de référence

1. Les autorités compétentes transmettent des données de référence complètes et exactes à l'AEMF chaque jour au plus tard à 23h59 (HEC), en utilisant le canal de communication électronique sécurisé mis en place à cet effet entre elles-mêmes et l'AEMF.
2. Le jour suivant la réception des données de référence conformément au paragraphe 1, l'AEMF consolide les données reçues de chaque autorité compétente.
3. L'AEMF met les données consolidées à la disposition de toutes les autorités compétentes avant 8h00 (HEC) le jour suivant leur réception, en utilisant les canaux de communication électroniques sécurisés visés au paragraphe 1.
4. Les autorités compétentes utilisent les données consolidées se rapportant à un jour donné pour valider les déclarations de transactions concernant les transactions exécutées le même jour et déclarées conformément à l'article 26 du règlement (UE) n° 600/2014.
5. Chaque autorité compétente utilise les données consolidées se rapportant à un jour donné pour échanger les déclarations de transactions présentées le même jour conformément à l'article 26, paragraphe 1, deuxième alinéa, du règlement (UE) n° 600/2014.
6. L'AEMF publie les données de référence sous une forme électronique, téléchargeable et lisible par machine.

*Article 8***Entrée en vigueur et application**

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

Il s'applique à compter de la date visée à l'article 55, deuxième alinéa, du règlement (UE) n° 600/2014.

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

Fait à Bruxelles, le 14 juillet 2016.

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE

Tableau 1

Légende du tableau 3

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{ALPHANUM-n}	Jusqu'à n caractères alphanumériques	Texte 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: AAAA-MM-JJThh:mm:ss.dddddZ. — «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.ddddd» 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 n chiffres au total dont m chiffres tout au plus peuvent être des décimales	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.
{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

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
		«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 (Future SWAP)
{INTEGER-n}	Nombre entier de n 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	

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
	«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)
	«OILP» — Pétrole	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — 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» — Naphta «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	

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
«ENVR» — Environnement	«EMIS» — Émissions	«CERE» — Unités de réduction certifiée des émissions (URCE) «ERUE» — Unités de réduction des émissions (URE) «EUAE» — Quotas d'émission UE «EUAA» — Quotas du secteur de l'aviation UE «OTHR» — Autres
	«WTHR» — Climatique «CRBR» — Carbone	
«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

Catégories de produits	Sous-catégories de produits	Produits
«MCEX» — Exotiques multi-produits		
«PAPR» — Papier	«CBRD» — Papier pour carton ondulé «NSPT» — Papier journal «PULP» — Pâte à papier «RCVP» — Papier recyclé	
«POLY» — Polypropylène	«PLST» — Plastiques	
«INFL» — Inflation		
«OEST» — Statistiques économiques officielles		
«OTHC» — Autres C10 au sens du tableau 10.1 de la section 10 de l'annexe III du règlement délégué (UE) 2017/583 de la Commission ⁽¹⁾		
«OTHR» — Autres		

⁽¹⁾ Règlement délégué (UE) 2017/583 de la Commission du 14 juillet 2016 complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil concernant les marchés d'instruments financiers 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 (voir page 229 du présent Journal officiel).

Tableau 3

Informations à fournir en tant que données de référence relatives aux instruments financiers

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
Champs généraux			
1	Code d'identification de l'instrument	Code utilisé pour identifier l'instrument financier.	{ISIN}
2	Nom complet de l'instrument	Nom complet de l'instrument financier	{ALPHANUM-350}
3	Classement de l'instrument	Taxonomie utilisée pour classer l'instrument financier. Fournir un code complet et exact de la classification ISO des instruments financiers (code CFI).	{CFI_CODE}
4	Indicateur de dérivés sur matières premières ou quotas d'émission	Indiquer si l'instrument financier entre dans la définition d'un dérivé sur matières premières au sens de l'article 2, paragraphe 1, point 30, du règlement (UE) n° 600/2014 ou d'un dérivé sur quotas d'émission au sens de l'annexe I, section C, point 4, de la directive 2014/65/UE.	«true» — Oui «false» — Non
Champs concernant l'émetteur			
5	Identifiant de l'émetteur ou de l'opérateur de la plate-forme de négociation	Identifiant d'entité juridique (LEI) de l'émetteur ou de l'opérateur de la plate-forme de négociation.	{LEI}

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
Champs concernant la plate-forme de négociation			
6	Plate-forme de négociation	S'il est disponible, code MIC de segment (<i>segment MIC</i>) de la plate-forme de négociation ou de l'internalisateur systématique, ou, à défaut, code MIC d'exploitation (<i>operating MIC</i>).	{MIC}
7	Nom abrégé de l'instrument financier	Nom abrégé de l'instrument financier conformément à la norme ISO 18774.	{FISN}
8	Demande d'admission à la négociation introduite par l'émetteur	Indiquer si l'émetteur de l'instrument financier a demandé ou approuvé la négociation ou l'admission à la négociation de son instrument financier sur une plate-forme de négociation.	«true» — Oui «false» — Non
9	Date d'approbation de l'admission à la négociation	Date et heure auxquelles l'émetteur a approuvé l'admission à la négociation ou la négociation de son instrument financier sur une plate-forme de négociation.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Date de la demande d'admission à la négociation	Date et heure de la demande d'admission à la négociation sur la plate-forme de négociation.	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Date d'admission à la négociation ou date de la première négociation	Date et heure de l'admission à la négociation sur la plate-forme de négociation ou date et heure auxquelles l'instrument a été négocié pour la première fois ou auxquelles un ordre ou un prix a été reçu pour la première fois par la plate-forme de négociation.	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Date de cessation	Si elles sont connues, date et heure auxquelles l'instrument financier cesse d'être négocié ou d'être admis à la négociation sur la plate-forme de négociation.	{DATE_TIME_FORMAT}
Champs concernant le notionnel			
13	Monnaie du notionnel 1	Monnaie dans laquelle le notionnel est libellé. Pour les contrats dérivés sur taux d'intérêt ou sur devises, indiquer la monnaie du notionnel de la jambe 1 ou la monnaie 1 de la paire. Pour les options d'échange (<i>swaptions</i>) fondées sur un contrat d'échange (<i>swap</i>) sous-jacent libellé dans une seule monnaie, indiquer la monnaie du notionnel du contrat d'échange sous-jacent. Pour les options d'échange fondées sur un contrat d'échange sous-jacent multidevises, indiquer la monnaie du notionnel de la jambe 1 du contrat d'échange.	{CURRENCYCODE_3}
Champs concernant les obligations ou autres titres de créance			
14	Montant nominal émis total	Montant nominal émis total, exprimé en valeur monétaire.	{DECIMAL-18/5}
15	Date d'échéance	Date d'échéance de l'instrument financier. Ce champ concerne les titres de créance à échéance définie.	{DATEFORMAT}
16	Monnaie de la valeur nominale	Monnaie de la valeur nominale pour les titres de créance.	{CURRENCYCODE_3}
17	Valeur nominale unitaire/valeur négociée minimale	Valeur nominale de chaque instrument. Si elle n'est pas connue, indiquer la valeur négociée minimale.	{DECIMAL-18/5}

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
18	Taux fixe	Pourcentage de rendement à taux fixe sur un titre de créance détenu jusqu'à l'échéance, exprimé sous forme de pourcentage.	{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	Si un tel identifiant existe.	{ISIN}
20	Nom de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	Si aucun identifiant n'existe, nom de l'indice.	{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	Durée de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable. La durée doit être exprimée en jours, semaines, mois ou années.	{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	Nombre de points de base au-dessus ou en dessous de l'indice utilisé pour le calcul d'un prix.	{INTEGER-5}
23	Rang de l'obligation	Indiquer le type d'obligation: dette de premier rang (senior), mezzanine, subordonnée ou de rang inférieur (junior).	«SNDB» — Dette de premier rang (senior) «MZZD» — Dette mezzanine «SBOD» — Dette subordonnée «JUND» — Dette de rang inférieur (junior)

Champs concernant les instruments dérivés et les instruments dérivés titrisés

24	Date d'expiration	Date d'expiration de l'instrument financier. Ce champ s'applique uniquement aux instruments dérivés assortis d'une date d'expiration définie.	{DATEFORMAT}
25	Multiplicateur du prix	Nombre d'unités de l'instrument sous-jacent représentées par un même contrat dérivé. Pour un contrat à terme ou une option sur indice, indiquer le montant par point d'indice. Pour les contrats permettant de miser sur un écart (<i>spread bets</i>), indiquer la variation du prix de l'instrument sous-jacent sur laquelle se base le contrat.	{DECIMAL-18/17}
26	Code de l'instrument sous-jacent	Code ISIN (International Securities Identification Number — numéro international d'identification des titres) de l'instrument sous-jacent. Pour les certificats américains représentatifs de dépôt d'actions (ADR), les certificats mondiaux représentatifs de dépôt d'actions (GDR) et les instruments similaires, indiquer le code ISIN de l'instrument financier sur lequel ces instruments sont basés. Pour les obligations convertibles, indiquer le code ISIN de l'instrument en lequel l'obligation peut être convertie. Pour les instruments dérivés ou les autres instruments fondés sur un sous-jacent, indiquer le code ISIN de l'instrument sous-jacent lorsque ce dernier est admis à la négociation ou négocié sur une plate-forme de négociation. Si le sous-jacent est un dividende en actions, indiquer le code ISIN des actions donnant droit au dividende sous-jacent.	{ISIN}

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
		<p>Pour les contrats d'échange sur risque de crédit, indiquer le code ISIN de l'obligation de référence.</p> <p>Si le sous-jacent est un indice et est assorti d'un code ISIN, indiquer le code ISIN de l'indice.</p> <p>Si le sous-jacent est un panier, indiquer le code ISIN de chaque composante du panier qui est admise à la négociation ou négociée sur une plate-forme de négociation. Les champs 26 et 27 doivent être remplis autant de fois que nécessaire pour inclure tous les instruments du panier.</p>	
27	Émetteur du sous-jacent	Si l'instrument ne renvoie pas à un seul instrument, mais à un émetteur, indiquer le code LEI de l'émetteur.	{LEI}
28	Nom de l'indice sous-jacent	Si le sous-jacent est un indice, indiquer le nom de l'indice.	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — si l'indice ne figure pas sur la liste {INDEX}
29	Durée de l'indice sous-jacent	Si le sous-jacent est un indice, indiquer la durée de l'indice.	{INTEGER-3} + «DAYS» — jours {INTEGER-3} + «WEEK» — semaines {INTEGER-3} + «MNTH» — mois {INTEGER-3} + «YEAR» — années
30	Type d'option	<p>Indiquer si le contrat dérivé est une option d'achat (droit à l'achat d'un actif sous-jacent spécifique) ou une option de vente (droit à la vente d'un actif sous-jacent spécifique) ou si l'on ne peut établir si l'option exercée sera une option d'achat ou une option de vente au moment de l'exécution. En ce qui concerne les options d'échange, indiquer:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «option de vente» dans le cas d'une option d'échange «receveur» (<i>receiver swaption</i>), dans le cadre de laquelle l'acheteur a le droit de conclure un contrat d'échange en tant que receveur de taux fixe; — «option d'achat» dans le cas d'une option d'échange «payeur» (<i>payer swaption</i>), dans le cadre de laquelle l'acheteur a le droit de conclure un contrat d'échange en tant que payeur de taux fixe. <p>En ce qui concerne les plafonds et planchers, indiquer:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «option de vente», dans le cas d'un plancher; — «option d'achat», dans le cas d'un plafond. Ce champ ne concerne que les dérivés qui sont des options ou des bons de souscription d'actions (<i>warrants</i>). 	<p>«PUTO» — Vente</p> <p>«CALL» — Achat</p> <p>«OTHER» — si la nature de l'option (achat ou vente) ne peut être établie</p>
31	Prix d'exercice	<p>Prix prédéterminé auquel le détenteur devra acheter ou vendre l'instrument sous-jacent, ou indication du fait que le prix ne peut être déterminé au moment de l'exécution.</p> <p>Ce champ ne concerne que les options ou bons de souscription d'actions dont le prix d'exercice peut être déterminé au moment de l'exécution.</p> <p>Si le prix n'est pas encore disponible, la valeur à indiquer est «PNDG» («en attente»).</p> <p>Lorsque le prix d'exercice est sans objet, ne pas remplir ce champ.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} si le prix est exprimé en valeur monétaire</p> <p>{DECIMAL-11/10} si le prix est exprimé en pourcentage ou en taux de rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} si le prix est exprimé en points de base</p> <p>«PNDG» si le prix n'est pas encore disponible</p>
32	Monnaie du prix d'exercice	Monnaie du prix d'exercice.	{CURRENCYCODE_3}

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
33	Modalités d'exercice de l'option	Indiquer si l'option peut être exercée à une date fixe uniquement (option européenne ou asiatique), à plusieurs dates prédéterminées (option bermudienne) ou à n'importe quel moment de la vie du contrat (option américaine). Ce champ s'applique uniquement aux options, aux bons de souscription d'actions et aux certificats de droits (<i>entitlement certificates</i>).	«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	Indiquer si l'instrument financier est réglé physiquement ou en espèces. Si le type de livraison ne peut être déterminé au moment de l'exécution, indiquer «OPTL». Ce champ ne concerne que les instruments dérivés.	«PHYS» — règlement physique «CASH» — règlement en numéraire «OPTN» — Optionnel pour la contrepartie ou décidé par un tiers

Instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission

35	Catégories de produits	Catégories d'actifs sous-jacents indiquées dans le tableau de classification des instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission.	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
36	Sous-catégories de produits	Sous-catégories d'actifs sous-jacents indiquées dans le tableau de classification des instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission. Remplir préalablement le champ «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.
37	Produits	Actifs sous-jacents indiqués dans le tableau de classification des instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission. Remplir préalablement le champ «Sous-catégories de produits».	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
38	Type de transaction	Type de transaction, tel que précisé par la plate-forme de négociation.	«FUTR» — Contrats à terme «OPTN» — Options «TAPO» — TAPOS «SWAP» — Contrats d'échange «MINI» — Minis «OTCT» — De gré à gré (OTC) «ORIT» — Outright «CRCK» — Crack «DIFF» — Différentiel «OTHR» — Autres
39	Type de prix final	Type de prix final, tel que précisé par la plate-forme de négociation.	«ARGM» — Argus/McCloskey «BLTC» — Baltic «EXOF» — Exchange «GBCL» — GlobalCOAL «IHSM» — IHS McCloskey «PLAT» — Platts «OTHR» — Autres

N.	CHAMP	INFORMATIONS À FOURNIR	NORMES ET FORMATS À RESPECTER
Dérivés sur taux d'intérêt			
— Les champs de cette section ne concernent que les instruments ayant pour sous-jacent un instrument non financier de type taux d'intérêt.			
40	Taux de référence	Nom du taux de référence.	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — si l'indice ne figure pas sur la liste {INDEX}
41	Durée du contrat (taux d'intérêt)	Si l'actif relève de la catégorie des taux d'intérêt, indiquer la durée du contrat. La durée doit être exprimée en jours, semaines, mois ou années.	{INTEGER-3} + «DAYS» — jours {INTEGER-3} + «WEEK» — semaines {INTEGER-3} + «MNTH» — mois {INTEGER-3} + «YEAR» — années
42	Monnaie du notionnel 2	Pour les contrats d'échange multidevises ou les crédits croisés, indiquer la monnaie dans laquelle la jambe 2 du contrat est libellée. Pour les options d'échange dont le sous-jacent est un contrat d'échange multidevises, indiquer la monnaie dans laquelle la jambe 2 du contrat d'échange est libellée.	{CURRENCYCODE_3}
43	Taux fixe de la jambe 1	Indication du taux fixe utilisé pour la jambe 1, s'il y a lieu.	{DECIMAL -11/10} En pourcentage (ex: 7.0 = 7 % et 0.3 = 0,3 %)
44	Taux fixe de la jambe 2	Indication du taux fixe utilisé pour la jambe 2, s'il y a lieu.	{DECIMAL -11/10} En pourcentage (ex: 7.0 = 7 % et 0.3 = 0,3 %)
45	Taux variable de la jambe 2	Indication du taux d'intérêt utilisé, s'il y a lieu.	{INDEX} ou {ALPHANUM-25} — si le taux de référence ne figure pas sur la liste {INDEX}
46	Durée de la jambe 2 du contrat (taux d'intérêt)	Indication de la période de référence du taux d'intérêt, qui est fixé à intervalles prédéterminés par rapport à un taux de référence du marché. La durée doit être exprimée en jours, semaines, mois ou années.	{INTEGER-3} + «DAYS» — jours {INTEGER-3} + «WEEK» — semaines {INTEGER-3} + «MNTH» — mois {INTEGER-3} + «YEAR» — années

Dérivés de change

— Les champs de cette section ne concernent que les instruments ayant pour sous-jacent un instrument non financier de type devise.

47	Monnaie du notionnel 2	Indiquer la monnaie sous-jacente 2 de la paire de monnaies (la monnaie 1 est à indiquer dans le champ 13, «Monnaie du notionnel 1»).	{CURRENCYCODE_3}
48	Type de devise	Type de monnaie sous-jacente.	«FXCR» — Cours croisés «FXEM» — Marchés des changes émergents «FXMJ» — Majors