

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2017/580 DE LA COMMISSION**du 24 juin 2016****complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation en ce qui concerne la conservation des données pertinentes relatives aux ordres sur instruments financiers****(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 25, paragraphe 3, quatrième alinéa,

considérant ce qui suit:

- (1) Les opérateurs de plates-formes de négociation devraient être libres de décider de la manière dont ils conservent les données pertinentes relatives à tous les ordres de transaction sur instruments financiers. Cependant, pour permettre un regroupement, une comparaison et une analyse efficaces de ces données à des fins de surveillance du marché, il convient, lorsque les autorités compétentes en font la demande conformément à l'article 25, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014, qu'elles soient mises à leur disposition selon des normes et dans des formats uniformes.
- (2) Pour des raisons de clarté et de sécurité juridique, et afin d'éviter le stockage en double exemplaire des mêmes informations, le présent règlement devrait couvrir tous les éléments d'information relatifs aux ordres de transaction, notamment les renseignements visés à l'article 26, paragraphes 1 et 3 du règlement MiFIR.
- (3) Afin de détecter et d'instruire efficacement d'éventuels abus de marché ou tentatives d'abus, les autorités compétentes ont besoin d'identifier rapidement les personnes et entités susceptibles d'être impliquées de manière significative dans le processus des ordres de transaction, notamment les membres ou participants de plates-formes de négociation, les entités chargées des décisions d'investissements et d'exécution, les courtiers non exécutants et les clients pour le compte desquels les ordres sont passés. En conséquence les opérateurs de plates-formes de négociation devraient identifier ces parties.
- (4) Pour permettre aux autorités compétentes de mieux identifier les schémas de comportement potentiellement abusif d'un client donné, y compris lorsque celui-ci opère par l'intermédiaire de plusieurs entreprises d'investissement, les opérateurs de plates-formes de négociation devraient enregistrer l'identité des clients pour le compte desquels leurs membres ou leurs participants ont soumis les ordres de transaction. Les opérateurs devraient identifier ces clients au moyen d'identifiants uniques pour rendre plus efficace et plus sûre cette identification et faciliter ainsi l'analyse des abus de marché potentiels dans lesquels les clients en question pourraient être impliqués.
- (5) Les opérateurs de plates-formes de négociation ne devraient pas être tenus d'enregistrer les identifiants des clients tout au long de la chaîne de négociation d'un instrument financier, mais uniquement celui du client pour le compte duquel le membre ou le participant a soumis l'ordre de transaction.
- (6) L'identification des stratégies de tenue de marché ou des activités similaires est importante pour permettre une détection efficace des manipulations de marché. Cela permet aux autorités compétentes de distinguer, d'une part, les flux d'ordres provenant d'une entreprise d'investissement agissant selon des modalités fixées à l'avance par l'émetteur de l'instrument sur lequel portent ces ordres ou bien par la plate-forme de négociation sur laquelle ils sont soumis, et, d'autre part, les flux d'ordres provenant d'une entreprise d'investissement agissant de sa propre initiative ou sur instruction de son client.
- (7) L'enregistrement de la date et de l'heure précises ainsi que des détails de tout placement, modification, annulation, rejet ou exécution d'un ordre devrait être conservé. Ceci permet en effet de suivre les changements apportés à l'ordre pendant toute sa durée de vie, ce qui peut être déterminant pour détecter et évaluer les éventuelles manipulations de marchés et pratiques de front running.

⁽¹⁾ JO L 173 du 12.6.2014, p. 84.

- (8) Pour avoir une image exacte et complète du carnet d'ordres d'une plate-forme de négociation, les autorités compétentes ont besoin d'informations sur les séances de négociation durant lesquelles les instruments financiers sont échangés. Ces informations peuvent notamment servir à déterminer quand les phases de fixing ou de négociation en continu commencent et s'achèvent et si les ordres de négociation provoquent des interruptions de cotation non programmées (mécanisme de coupe-circuit). Elles sont également nécessaires pour déterminer comment les ordres vont interagir, en particulier lorsque les séances prennent fin de manière aléatoire comme dans le cas du fixing. Des informations sur le cours auquel le fixing devrait conduire et sur le volume susceptible d'être exécuté à ce cours indicatif faciliteraient également l'analyse d'éventuelles manipulations du fixing. Étant donné qu'un seul ordre particulier peut influencer ce cours ou ce volume ou les deux, les autorités compétentes ont besoin de connaître l'impact de chaque ordre sur ces valeurs. Sans cette information, il serait difficile de déterminer quel ordre a influencé ces valeurs. En outre, il convient d'attribuer un numéro de séquence à chaque événement pertinent pour déterminer l'ordre dans lequel ils se succèdent lorsque deux ou plusieurs d'entre eux ont lieu en même temps.
- (9) La spécification de la position des ordres dans un carnet d'ordres permet la reconstruction de ce carnet et l'analyse de la séquence d'exécution des ordres, laquelle constitue un élément important de la surveillance des abus de marché. La position assignée à un ordre dépend de la manière dont la priorité est déterminée par le système de négociation. Les opérateurs de plates-formes de négociation devraient donc assigner une priorité aux ordres en utilisant la priorité prix-visibilité-temps ou la priorité taille-temps et conserver cette information.
- (10) Pour permettre une surveillance efficace du marché, il est nécessaire d'être en mesure de relier les ordres aux transactions correspondantes. En conséquence, les opérateurs de plates-formes de négociation devraient utiliser des codes d'identification de transaction distinctifs reliant les ordres aux transactions.
- (11) Pour chaque ordre qu'ils reçoivent, les opérateurs de plates-formes de négociation devraient enregistrer et conserver le type d'ordre et les instructions spécifiques y afférentes, qui, ensemble, déterminent la manière dont chaque ordre doit être traité par leurs moteurs d'appariement conformément à leurs propres classifications. Ces informations détaillées sont essentielles pour que les autorités compétentes puissent contrôler, dans le cadre de la surveillance des abus de marché, l'activité de négociation dans un carnet d'ordres donné d'une plate-forme de négociation, et notamment reproduire le comportement de chaque ordre à l'intérieur de ce carnet. Toutefois, compte tenu du large éventail de nouveaux types d'ordres existants et potentiels conçus par les opérateurs de plates-formes de négociation et des spécificités techniques de ces derniers, la conservation de ces informations détaillées selon le système de classification interne des opérateurs risque de ne pas permettre actuellement aux autorités compétentes de reproduire de manière cohérente l'activité des carnets d'ordres de toutes les plates-formes de négociation. En conséquence, pour que les autorités compétentes soient en mesure de situer avec précision chaque ordre dans le carnet d'ordres, les opérateurs de plates-formes de négociation devraient également classer chaque ordre qu'ils reçoivent soit comme un ordre à cours limité lorsque cet ordre est exécutable, soit comme un ordre stop lorsqu'il ne devient exécutable que si un certain événement de prix se réalise.
- (12) Par souci de cohérence et afin d'assurer le bon fonctionnement des marchés financiers, les dispositions prévues par le présent règlement et celles prévues par le règlement (UE) n° 600/2014 devraient s'appliquer à partir de la même date.
- (13) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques de réglementation soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF).
- (14) L'AEMF a procédé à des consultations publiques sur les projets de normes techniques de réglementation sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels qu'ils impliquent 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

Étendue, normes et formats des données pertinentes relatives aux ordres

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation tiennent à la disposition de leur autorité compétente les détails de chaque ordre de transaction affiché par leur système tels que décrits dans les articles 2 à 13 et spécifiés dans les deuxième et troisième colonnes du tableau 2 de l'annexe, dans la mesure où ils se rapportent à l'ordre concerné.

⁽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. Lorsqu'en application de l'article 25, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014, les autorités compétentes demandent des renseignements visés au paragraphe 1, les opérateurs de plates-formes de négociation communiquent ces renseignements en respectant les normes et formats prescrits dans la quatrième colonne du tableau 2 de l'annexe du présent règlement.

Article 2

Identification des parties concernées

1. Pour tous les ordres de transaction, les opérateurs des plates-formes de négociation tiennent un relevé des personnes et informations suivantes:
 - a) le membre ou le participant de la plate-forme de négociation qui a soumis l'ordre à la plate-forme, identifié comme indiqué dans le champ 1 du tableau 2 de l'annexe;
 - b) la personne ou l'algorithme informatique, au sein du membre ou du participant de la plate-forme de négociation à laquelle l'ordre est soumis, qui est responsable de la décision d'investissement correspondant à l'ordre, identifié(e) comme indiqué dans le champ 4 du tableau 2 de l'annexe;
 - c) la personne ou l'algorithme informatique, au sein du membre ou du participant de la plate-forme de négociation, qui est responsable de l'exécution de l'ordre, identifié(e) comme indiqué dans le champ 5 du tableau 2 de l'annexe;
 - d) le membre ou le participant de la plate-forme de négociation qui a transmis l'ordre pour le compte et au nom d'un autre membre ou participant de cette plate-forme et qui est identifié en tant que courtier non exécutant comme indiqué dans le champ 6 du tableau 2 de l'annexe;
 - e) le client pour le compte duquel le membre ou le participant de la plate-forme de négociation a soumis l'ordre à la plate-forme, identifié comme indiqué dans le champ 3 du tableau 2 de l'annexe.
2. Lorsqu'un membre, un participant ou un client de la plate-forme de négociation est autorisé, en vertu de la législation d'un État membre, à attribuer un ordre à son client après la soumission de cet ordre à la plateforme de négociation et qu'il n'a pas encore attribué l'ordre à son client au moment de sa soumission, ledit ordre est identifié comme indiqué dans le champ 3 du tableau 2 de l'annexe.
3. Lorsque plusieurs ordres sont soumis ensemble à la plateforme de négociation sous forme d'ordre groupé, cet ordre groupé est identifié comme indiqué dans le champ 3 du tableau 2 de l'annexe.

Article 3

Type de négociation exercée par les membres ou participants de la plate-forme de négociation et activité d'apport de liquidité

1. La capacité en laquelle le membre ou le participant de la plate-forme de négociation soumet un ordre est décrite comme indiqué dans le champ 7 du tableau 2 de l'annexe.
2. Les ordres suivants sont identifiés comme indiqué dans le champ 8 du tableau 2 de l'annexe:
 - a) un ordre soumis à une plate-forme de négociation par un membre ou un participant dans le cadre d'une stratégie de tenue de marché conformément aux articles 17 et 48 de la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾;
 - b) un ordre soumis à une plate-forme de négociation par un membre ou un participant dans le cadre de toute autre activité d'apport de liquidité exercée selon des modalités fixées à l'avance soit par l'émetteur de l'instrument sur lequel porte l'ordre, soit par ladite plate-forme de négociation.

⁽¹⁾ Directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers et modifiant la directive 2002/92/CE et la directive 2011/61/UE (JO L 173 du 12.6.2014, p. 349).

*Article 4***Enregistrement de la date et de l'heure**

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent la date et de l'heure de chaque événement mentionné dans le champ 21 du tableau 2 de l'annexe du présent règlement en veillant à respecter le niveau de précision prescrit par l'article 2 du règlement délégué (UE) 2017/574 de la Commission ⁽¹⁾, comme indiqué dans le champ 9 du tableau 2 de l'annexe du présent règlement. À l'exception de l'enregistrement de la date et de l'heure du rejet d'un ordre par les systèmes des plates-formes de négociation, tous les événements mentionnés dans le champ 21 du tableau 2 de l'annexe du présent règlement sont enregistrés au moyen des horloges professionnelles utilisées par les moteurs d'appariement de ces plates-formes.
2. Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent la date et l'heure de chaque élément d'information mentionné dans les champs 49, 50 et 51 du tableau 2 de l'annexe du présent règlement, en veillant à respecter le niveau de précision prescrit par l'article 2 du règlement délégué (UE) 2017/574.

*Article 5***Durée de validité et restriction des ordres**

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent les durées de validité et les restrictions des ordres énumérées dans les champs 10 et 11 du tableau 2 de l'annexe.
2. Le relevé des dates et des heures concernant les durées de validité est effectué comme indiqué dans le champ 12 du tableau 2 de l'annexe pour chacune de ces périodes.

*Article 6***Priorité et numéro de séquence**

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation qui exploitent des systèmes de négociation utilisant la méthode de la priorité prix-visibilité-temps enregistrent l'horodatage de la priorité pour tous les ordres comme indiqué dans le champ 13 du tableau 2 de l'annexe. L'horodatage de la priorité possède le même degré de précision que celui prescrit par l'article 4, paragraphe 1.
2. Les opérateurs de plates-formes de négociation qui exploitent des systèmes de négociation utilisant la méthode de la priorité taille-temps conservent un relevé des quantités qui déterminent la priorité des ordres comme indiqué dans le champ 14 du tableau 2 de l'annexe ainsi que l'horodatage de la priorité visé au paragraphe 1.
3. Les opérateurs de plates-formes de négociation qui utilisent une combinaison des méthodes de priorité prix-visibilité-temps et taille-temps et qui affichent les ordres dans leurs carnets d'ordres selon la priorité temps se conforment aux dispositions du paragraphe 1.
4. Les opérateurs de plates-formes de négociation qui utilisent une combinaison des méthodes de priorité prix-visibilité-temps et taille-temps et qui affichent les ordres dans leurs carnets d'ordres selon la priorité taille-temps se conforment aux dispositions du paragraphe 2.
5. Les opérateurs de plates-formes de négociation attribuent un numéro de séquence à tous les événements comme indiqué dans le champ 15 du tableau 2 de l'annexe et conservent un relevé de ces numéros.

*Article 7***Code d'identification des ordres de transaction sur instruments financiers**

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation attribuent un code d'identification individuel à chaque ordre comme indiqué dans le champ 20 du tableau 2 de l'annexe. Le code d'identification est unique par carnet d'ordres, par jour de négociation et par instrument financier. Il est applicable à partir de la réception de l'ordre par l'opérateur de la plate-forme de négociation jusqu'à sa suppression du carnet d'ordres. Le code d'identification s'applique également aux ordres rejetés, quel que soit le motif du rejet.

⁽¹⁾ Règlement délégué (UE) 2017/574 de la Commission du 7 juin 2016 complétant la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil eu égard aux normes techniques de réglementation pour le niveau de précision des horloges professionnelles (voir page 148 du présent Journal officiel).

2. L'opérateur de la plate-forme de négociation enregistre les détails pertinents des ordres de stratégie avec fonctionnalité implicite (strategy orders with implied functionality, ou «SOIF») qui sont diffusés au public comme indiqué dans l'annexe. Le champ 33 du tableau 2 de l'annexe inclut une déclaration indiquant que l'ordre est un ordre implicite.

Lors de l'exécution d'un ordre de stratégie avec fonctionnalité implicite, les détails pertinents de cet ordre sont conservés par l'opérateur de la plate-forme de négociation comme indiqué dans l'annexe.

Lors de l'exécution d'un ordre de stratégie avec fonctionnalité implicite, un code d'identification des ordres liés à la stratégie est indiqué, le même code étant attribué à tous les ordres liés à la stratégie en question. Le code d'identification des ordres liés à une stratégie prend la forme indiquée dans le champ 46 du tableau 2 de l'annexe.

3. Les ordres soumis à une plate-forme de négociation permettant une stratégie de routage sont identifiés par cette plate-forme comme des «ordres acheminés», comme indiqué dans le champ 33 du tableau 2 de l'annexe, lorsqu'ils sont dirigés vers une autre plate-forme. Les ordres soumis à une plate-forme de négociation permettant une stratégie de routage conservent le même code d'identification pendant toute leur durée de vie, que le solde éventuel de l'ordre soit ou non réaffiché dans le carnet d'ordres de départ.

Article 8

Événements affectant les ordres de transaction sur instruments financiers

Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent les informations visées dans le champ 21 du tableau 2 de l'annexe en ce qui concerne les nouveaux ordres.

Article 9

Type d'ordre de transaction sur instruments financiers

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent selon leur propre classification le type d'ordre auquel appartient chaque ordre qu'ils reçoivent, comme indiqué dans le champ 22 du tableau 2 de l'annexe.

2. Les opérateurs de plates-formes de négociation classent chaque ordre qu'ils reçoivent soit en tant qu'ordre à cours limité, soit en tant qu'ordre stop, comme indiqué dans le champ 23 du tableau 2 de l'annexe.

Article 10

Cours relatifs aux ordres

Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent toutes les informations relatives aux cours visées dans la section I du tableau 2 de l'annexe pour autant qu'elles concernent les ordres.

Article 11

Instructions des ordres

Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent toutes les instructions reçues pour chaque ordre comme indiqué dans la section J du tableau 2 de l'annexe.

Article 12

Code d'identification de transaction de la plate-forme de négociation

Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent un code d'identification de transaction individuel pour chaque transaction résultant de l'exécution totale ou partielle d'un ordre, comme indiqué dans le champ 48 du tableau 2 de l'annexe.

*Article 13***Phases de négociation et cours et volumes de fixing indicatifs**

1. Les opérateurs de plates-formes de négociation enregistrent pour chaque ordre les informations relatives aux phases de négociation et aux cours et volumes de fixing indicatifs comme indiqué dans la section K du tableau 2 de l'annexe.
2. Lorsque les autorités compétentes requièrent, en vertu de l'article 1^{er}, des informations visées dans la section K concernant un ordre précis, les renseignements visés dans les champs 9 et 15 à 18 du tableau 2 de l'annexe sont également considérés comme des informations concernées par cette demande.

*Article 14***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 est applicable 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 24 juin 2016

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE

Tableau 1

Légende du tableau 2

SYMBOLE	TYPE DE DONNÉES	DÉFINITION
{ALPHANUM-n}	Jusqu'à n caractères alphanumériques	Champ permettant d'introduire un texte à contenu libre
{CURRENCYCODE_3}	3 caractères alphanumériques	Code monnaie à 3 lettres (code monnaie ISO 4217).
{DATE_TIME_FORMAT}	Format de date et heure ISO 8601	Date et heure selon le format suivant: AAAA-MM-JJThh: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 comptant au maximum n chiffres au total, dont m chiffres tout au plus peuvent être des décimales	Champ numérique pouvant contenir des valeurs positives ou négatives. — utiliser comme séparateur décimal le signe «.» (point); — faire précéder les valeurs négatives du signe «-» (moins); — Indiquer des valeurs arrondies et non tronquées.
{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.
{NATIONAL_ID}	35 caractères alphanumériques	Il s'agit de l'identifiant visé à l'article 6 et à l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/590 de la Commission ⁽¹⁾ .

⁽¹⁾ Règlement délégué (UE) 2017/590 de la Commission du 28 juillet 2016 complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation pour la déclaration de transactions aux autorités compétentes (voir page 449 du présent Journal officiel).

Tableau 2

Renseignements sur les ordres

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
Section A — Identification des parties concernées			
1	Identification de l'entité qui a soumis l'ordre	L'identité du membre ou participant de la plate-forme de négociation. Dans le cas d'un accès électronique direct (AED), il s'agit de l'identité du fournisseur d'AED.	{LEI}
2	Accès électronique direct (AED)	«vrai» lorsque l'ordre a été soumis à la plate-forme de négociation en utilisant un AED au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 41), de la directive 2014/65/UE. «faux» lorsque l'ordre n'a pas été soumis à la plate-forme de négociation en utilisant un AED au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 41), de la directive 2014/65/UE.	«vrai» «faux»
3	Code d'identification du client	Code utilisé pour identifier le client du membre ou participant de la plate-forme de négociation. En cas d'AED, il convient d'utiliser le code de l'utilisateur d'AED. Lorsque le client est une entité juridique, il convient d'utiliser son code LEI. Lorsque le client n'est pas une entité juridique, il convient d'utiliser son {NATIONAL_ID}. Dans le cas d'ordres groupés, il convient d'utiliser le code signalétique AGGR conformément à l'article 2, paragraphe 3, de ce règlement. Dans le cas d'attributions en attente, il convient d'utiliser le code signalétique PNAL conformément à l'article 2, paragraphe 2, de ce règlement. Ce champ n'est laissé vide que si le membre ou participant de la plate-forme de négociation n'a pas de clients.	{LEI} {NATIONAL_ID} «AGGR» — ordres groupés «PNAL» — attributions en attente
4	Décision d'investissement au sein de l'entreprise	Code utilisé pour identifier, au sein du membre ou participant de la plate-forme de négociation, la personne ou l'algorithme qui est responsable de la décision d'investissement conformément à l'article 8 du règlement délégué (UE) 2017/590. Lorsqu'une personne physique au sein du membre ou participant de la plate-forme de négociation est responsable de la décision d'investissement ou en assume la responsabilité première, elle est identifiée par son {NATIONAL_ID} Lorsqu'un algorithme était responsable de la décision d'investissement, ce champ doit être rempli conformément aux dispositions de l'article 8 du règlement délégué (UE) 2017/590. Ce champ est laissé vide lorsque la décision d'investissement n'a pas été prise par une personne ou un algorithme au sein du membre ou participant de la plate-forme de négociation.	{NATIONAL_ID} — Personnes physiques {ALPHANUM-50} — Algorithmes
5	Exécution au sein de l'entreprise	Code utilisé pour identifier, au sein du membre ou participant de la plate-forme de négociation, la personne ou l'algorithme qui est responsable de l'exécution de la transaction résultant de l'ordre conformément à l'article 9 du règlement délégué (UE) 2017/590. Lorsqu'une personne physique est responsable de l'exécution de la transaction, elle est identifiée par son {NATIONAL_ID}	{NATIONAL_ID} — Personnes physiques {ALPHANUM-50} — Algorithmes

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		<p>Lorsqu'un algorithme est responsable de l'exécution de la transaction, ce champ doit être rempli conformément aux dispositions de l'article 9 du règlement délégué (UE) 2017/590.</p> <p>Lorsque plusieurs personnes, ou à la fois des personnes et des algorithmes, interviennent dans l'exécution de la transaction, le membre ou participant ou client de la plate-forme de négociation détermine quel trader ou quel algorithme en assume la responsabilité première conformément à l'article 9, paragraphe 4, du règlement délégué (UE) 2017/590 et indique dans ce champ l'identité de ce trader ou de cet algorithme.</p>	
6	Courtier non exécutant	<p>Conformément à l'article 2, point d).</p> <p>Ce champ est laissé vide lorsqu'il est sans objet.</p>	{LEI}

Section B — Type de négociation et apport de liquidité

7	Type de négociation	<p>Indique si la soumission de l'ordre est le résultat de l'exercice, par le membre ou participant de la plate-forme de négociation, de la négociation par appariement avec interposition du compte propre au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 38), de la directive 2014/65/UE, ou de la négociation pour compte propre au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 6), de ladite directive.</p> <p>Lorsque la soumission de l'ordre n'est pas le résultat de l'exercice, par le membre ou participant de la plate-forme de négociation, de la négociation par appariement avec interposition du compte propre ou de la négociation pour compte propre, il convient d'indiquer dans ce champ que la transaction a été effectuée à un autre titre.</p>	<p>«DEAL» — Négociation pour compte propre</p> <p>«MTCH» — Négociation par appariement avec interposition du compte propre</p> <p>«AOTC» — Tout autre type de négociation</p>
8	Activité d'apport de liquidité	Indique si l'ordre a été soumis à la plate-forme de négociation dans le cadre d'une stratégie de tenue de marché conformément aux articles 17 et 48 de la directive 2014/65/UE ou s'il a été soumis dans le cadre d'une autre activité conformément à l'article 3 du présent règlement.	<p>«vrai»</p> <p>«faux»</p>

Section C — Date et heure

9	Date et heure	La date et l'heure de chaque événement figurant dans les sections [G] et [K].	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Le nombre de chiffres après les «secondes» est déterminé conformément à l'article 2 du règlement délégué (UE) 2017/574.</p>
---	---------------	---	--

Section D — Durée de validité et restriction des ordres

10	Durée de validité	<p>Good-For-Day (Validité jour): l'ordre expire à la fin de la séance de négociation au cours de laquelle il a été inscrit dans le carnet d'ordres.</p> <p>Good-Till-Cancelled (Validité jusqu'à révocation): l'ordre reste actif dans le carnet d'ordres et est exécutable tant qu'il n'a pas été annulé.</p>	<p>«DAVY» — Good-For-Day</p> <p>«GTCV» — Good-Till-Cancelled</p>
----	-------------------	--	--

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		<p>Good-Till-Time (Validité jusqu'à une certaine heure): l'ordre expire au plus tard à une certaine heure pendant la séance de négociation en cours.</p> <p>Good-Till-Date (Validité jusqu'à une certaine date): l'ordre expire à une certaine date à la fin de la séance.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time (Validité jusqu'à une certaine date à une certaine heure): l'ordre expire à une certaine date à une certaine heure.</p> <p>Good After Time (Validité après une certaine heure): l'ordre ne devient actif qu'après une certaine heure pendant la séance de négociation en cours.</p> <p>Good After Date (Validité après une certaine date): l'ordre ne devient actif qu'à une certaine date au début de la séance.</p> <p>Good After Specified Date and Time (Validité après une certaine date à une certaine heure): l'ordre ne devient actif qu'à partir d'une certaine date à une certaine heure.</p> <p>Immediate-Or-Cancel (Exécution immédiate ou annulation): l'ordre est exécuté dès son inscription dans le carnet d'ordres (à hauteur de la quantité pour laquelle l'exécution est possible) et la portion non exécutée (le cas échéant) est effacée du carnet d'ordres.</p> <p>Fill-Or-Kill (Ordre pour exécution intégrale immédiate ou annulation): l'ordre est exécuté dès son inscription dans le carnet d'ordres mais uniquement si l'exécution peut être intégrale; si l'exécution n'est que partiellement possible, il est automatiquement rejeté et ne peut donc pas être exécuté.</p> <p>Autre: toute autre indication qui est spécifique de certains modèles économiques, de certaines plates-formes de négociation ou de certains systèmes.</p>	<p>«GTTV» — Good-Till-Time</p> <p>«GTDV» — Good-Till-Date</p> <p>«GTSV» — Good-Till-Specified Date and Time</p> <p>«GATV» — Good After Time</p> <p>«GADV» — Good After Date</p> <p>«GASV» — Good After Specified Date and Time</p> <p>«IOCV» — Immediate-Or-Cancel</p> <p>«FOKV» — Fill-Or-Kill ou {ALPHANUM-4} caractères qui ne sont pas encore utilisés pour le propre classement de la plateforme de négociation.</p>
11	Restriction des ordres	<p>Good For Closing Price Crossing Session (Valable pour la phase de négociation au cours de clôture): lorsqu'un ordre remplit les conditions pour la phase de négociation au cours de clôture.</p> <p>Valid For Auction (Valable pour le fixing): l'ordre n'est actif et ne peut être exécuté que lors de phases de fixing (qui peuvent être prédéfinies par le membre ou participant de la plateforme de négociation qui a soumis l'ordre, par exemple fixing d'ouverture et/clôture et/ou fixing intrajournalier).</p> <p>Valid For Continuous Trading only (Valable uniquement pour la négociation en continu): l'ordre n'est actif que pendant la phase de négociation en continu.</p>	<p>«SESR» — Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>«VFAR» — Valid For Auction</p> <p>«VFCR» — Valid For Continuous Trading only</p>

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		Autre: toute autre indication qui est spécifique de certains modèles économiques, de certaines plates-formes de négociation ou de certains systèmes.	<p>{ALPHANUM-4} caractères qui ne sont pas encore utilisés pour le propre classement de la plate-forme de négociation.</p> <p>Lorsque plusieurs types sont applicables, il convient d'indiquer dans ce champ plusieurs codes signalétiques séparés par des virgules.</p>
12	Heure et période de validité	<p>Il s'agit de l'horodatage du moment à partir duquel l'ordre devient actif ou bien du moment à partir duquel il est retiré du carnet d'ordres.</p> <p>Good for day (Validité jour): la date d'entrée, l'horodatage indiquant juste avant minuit.</p> <p>Good-Till-Time (Validité jusqu'à une certaine heure): la date d'entrée et l'heure précisée dans l'ordre.</p> <p>Good-Till-Date (Validité jusqu'à une certaine date): la date d'expiration prévue, l'horodatage indiquant juste avant minuit.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time (Validité jusqu'à une certaine date à une certaine heure): la date et l'heure prévues de l'expiration.</p> <p>Good After Time (Validité après une certaine heure): la date d'entrée et l'heure à partir de laquelle il est prévu que l'ordre devienne actif.</p> <p>Good After Date (Validité après une certaine date): la date prévue, l'horodatage indiquant juste après minuit.</p> <p>Good After Specified Date and Time (Validité après une certaine date à une certaine heure): la date et l'heure à partir desquelles il est prévu que l'ordre devienne actif.</p> <p>Good till Cancel (Validité jusqu'à révocation): la date et l'heure ultimes où l'ordre sera automatiquement retiré par procédure de marché.</p> <p>Autre: horodatage pour tout autre type de validité.</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Le nombre de chiffres après les «secondes» est déterminé conformément à l'article 2 du règlement délégué (UE) 2017/574.</p>

Section E — Priorité et numéro de séquence

13	Horodatage de la priorité	Ce champ doit être mis à jour à chaque fois que la priorité d'un ordre change.	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Le nombre de chiffres après les «secondes» est déterminé conformément à l'article 2 du règlement délégué (UE) 2017/574.</p>
14	Priorité taille	<p>Pour les plates-formes de négociation qui utilisent la priorité taille-temps, il convient d'indiquer dans ce champ un nombre positif correspondant à la quantité.</p> <p>Ce champ doit être mis à jour à chaque fois que la priorité de l'ordre change.</p>	Jusqu'à 20 caractères numériques positifs.
15	Numéro de séquence	<p>Chaque événement mentionné dans la section G est identifié en utilisant des nombres entiers positifs en ordre croissant.</p> <p>Le numéro de séquence est propre à chaque type d'événement; constant pour tous les événements, horodaté par l'opérateur de la plate-forme de négociation; il reste le même pendant toute la journée où l'événement se produit.</p>	{INTEGER-50}

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
----	-------	--	--

Section F — Identification de l'ordre

16	Code MIC de segment (segment MIC)	<p>Identification de la plate-forme de négociation sur laquelle l'ordre a été soumis.</p> <p>Si la plateforme de négociation utilise des codes MIC de segment, indiquer le code MIC de segment.</p> <p>Si la plateforme de négociation n'utilise pas de codes MIC de segment, indiquer le code MIC d'exploitation (operating MIC)</p>	{MIC}
17	Code du carnet d'ordres	Le code alphanumérique que la plate-forme de négociation attribue spécifiquement à chaque carnet d'ordres.	{ALPHANUM-20}
18	Code d'identification de l'instrument financier	Identifiant unique et univoque de l'instrument financier	{ISIN}
19	Date de réception	Date de réception de l'ordre initial.	{DATEFORMAT}
20	Code d'identification de l'ordre	Un code alphanumérique que l'opérateur de la plate-forme de négociation attribue spécifiquement à chaque ordre.	{ALPHANUM-50}

Section G — Événements affectant l'ordre

21	Nouvel ordre, modification de l'ordre, annulation de l'ordre, rejet de l'ordre, exécution partielle ou totale de l'ordre	<p>Nouvel ordre: réception d'un nouvel ordre par l'opérateur de la plate-forme d'exécution.</p> <p>Déclenché: un ordre qui devient exécutable ou, le cas échéant, non-exécutable lorsqu'une certaine condition se réalise.</p> <p>Remplacé par le membre ou participant de la plate-forme de négociation: lorsqu'un membre, participant ou client de la plate-forme de négociation décide de sa propre initiative de modifier une ou plusieurs caractéristiques de l'ordre qu'il a précédemment introduit dans le carnet d'ordres.</p> <p>Remplacé par procédure de marché (automatique): lorsqu'une ou plusieurs caractéristiques d'un ordre sont modifiées par les systèmes informatiques de l'opérateur de la plate-forme de négociation. C'est notamment le cas lorsque les caractéristiques actuelles d'un ordre indexé (peg order) ou d'un ordre à seuil de déclenchement suiveur (trailing stop order) sont modifiées afin de rendre compte de la situation de l'ordre dans le carnet d'ordres.</p> <p>Remplacé par procédure de marché (intervention humaine): lorsqu'une ou plusieurs caractéristiques d'un ordre sont modifiées par le personnel de l'opérateur de la plate-forme de négociation. C'est notamment le cas lorsqu'un membre ou participant de la plate-forme de négociation rencontre des problèmes informatiques et a besoin que ses ordres soient annulés d'urgence.</p> <p>Changement de statut à l'initiative du membre ou participant de la plate-forme de négociation. Cela inclut l'activation et la désactivation.</p>	<p>«NEWO» — Nouvel ordre</p> <p>«TRIG» — Déclenché</p> <p>«REME» — Remplacé par le membre ou participant de la plate-forme de négociation</p> <p>«REMA» — Remplacé par procédure de marché (automatique)</p> <p>«REMH» — Remplacé par procédure de marché (intervention humaine)</p> <p>«CHME» — Changement de statut à l'initiative du membre/participant de la plate-forme de négociation</p>
----	--	--	---

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		<p>Changement de statut dû aux procédures de marché.</p> <p>Annulé à l'initiative du membre ou participant de la plate-forme de négociation; lorsqu'un membre, participant ou client décide de sa propre initiative d'annuler l'ordre qu'il a précédemment placé.</p> <p>Annulé par procédure de marché. Notamment dans le cas d'un mécanisme de protection prévu pour les entreprises d'investissement exerçant une activité de tenue de marché au sens des articles 17 et 48 de la directive 2014/65/UE.</p> <p>Ordre rejeté: un ordre reçu mais rejeté par l'opérateur de la plate-forme d'exécution.</p> <p>Ordre expiré: lorsque l'ordre est retiré du carnet d'ordres à la fin de sa période de validité.</p> <p>Partiellement exécuté: lorsque l'ordre n'est pas intégralement exécuté de sorte qu'il reste un solde à exécuter.</p> <p>Intégralement exécuté: lorsqu'il n'y a plus de solde à exécuter.</p>	<p>«CHMO» — Changement de statut dû aux procédures de marché</p> <p>«CAME» — Annulé à l'initiative du membre ou participant de la plate-forme de négociation</p> <p>«CAMO» — Annulé par procédure de marché</p> <p>«REMO» — Ordre rejeté</p> <p>«EXPI» — Ordre expiré</p> <p>«PARF» — Partiellement exécuté</p> <p>«FILL» — Intégralement exécuté {ALPHANUM-4} caractères qui ne sont pas encore utilisés pour le propre classement de la plate-forme de négociation.</p>

Section H — type d'ordre

22	Type d'ordre	Identifie le type d'ordre soumis à la plate-forme de négociation selon les spécifications de celle-ci.	{ALPHANUM-50}
23	Classement des types d'ordres	<p>Classement de l'ordre selon deux types génériques d'ordres.</p> <p>Ordre à cours limité: lorsque l'ordre est exécutable et</p> <p>Ordre stop: lorsque l'ordre ne devient exécutable que si un certain événement de prix se réalise.</p>	Les lettres «LMTO» pour ordre à cours limité ou les lettres «STOP» pour ordre stop.

Section I — Cours

24	Cours limité	<p>Le prix maximal auquel un ordre d'achat peut être exécuté ou le prix minimal auquel un ordre de vente peut être exécuté.</p> <p>L'écart de prix pour un ordre de stratégie (strategy order). Il peut être positif ou négatif.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} lorsque le prix est exprimé sous forme de valeur monétaire.</p> <p>Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure.</p>
----	--------------	--	--

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		Ce champ doit rester vide dans le cas des ordres qui n'ont pas de cours limité ou pour tout ordre sans prix. Dans le cas d'une obligation convertible, le prix réel (au pied de coupon ou coupon couru) utilisé pour l'ordre est indiqué dans ce champ	{DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement. {DECIMAL-18/17} lorsque le prix est exprimé en points de base
25	Cours limité supplémentaire	Toute autre limite de prix pouvant s'appliquer à l'ordre. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{DECIMAL-18/13} lorsque le prix est exprimé sous forme de valeur monétaire. Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure. {DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement. {DECIMAL-18/17} lorsque le prix est exprimé en points de base
26	Prix de déclenchement (Stop price)	Le prix qui doit être atteint pour que l'ordre devienne actif. Pour les ordres stop déclenchés par des événements indépendants du prix de l'instrument financier, il convient d'indiquer dans ce champ un prix de déclenchement égal à zéro. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{DECIMAL-18/13} lorsque le prix est exprimé sous forme de valeur monétaire. Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure. {DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement. {DECIMAL-18/17} lorsque le prix est exprimé en points de base.
27	Cours limité ordre indexé	Le prix maximal auquel un ordre d'achat indexé peut être exécuté ou le prix minimal auquel un ordre de vente indexé peut être exécuté. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{DECIMAL-18/13} lorsque le prix est exprimé sous forme de valeur monétaire. Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure. {DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement. {DECIMAL-18/17} lorsque le prix est exprimé en points de base

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
28	Prix de transaction	<p>Prix d'exécution de la transaction, le cas échéant hors commission et intérêts courus.</p> <p>Dans le cas des contrats d'option, il s'agit de la prime du contrat dérivé par titre sous-jacent ou par point d'indice.</p> <p>Dans le cas de contrats permettant de miser sur un écart (spread bets), il s'agit du prix de référence de l'instrument directement sous-jacent.</p> <p>Pour les contrats d'échange sur risque de défaut (CDS), il s'agit du coupon en points de base.</p> <p>Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure.</p> <p>Lorsque le prix est sans objet, il convient d'indiquer dans ce champ le sigle «NOAP».</p>	<p>{DECIMAL-18/13} lorsque le prix est exprimé sous forme monétaire.</p> <p>{DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} lorsque le prix est exprimé en points de base</p> <p>«NOAP»</p>
29	Monnaie du cours	Monnaie dans laquelle est exprimé le cours pour l'instrument financier lié à l'ordre (applicable si le prix est exprimé en valeur monétaire).	{CURRENCYCODE_3}
30	Monnaie de la jambe 2	<p>Lorsqu'il y a des contrats d'échange multidevises ou des crédits croisés, la monnaie de la jambe 2 est la monnaie dans laquelle la jambe 2 du contrat est libellée.</p> <p>Pour les options d'échange (swaptions) dont le sous-jacent est un contrat d'échange multidevises, la monnaie de la jambe 2 est la monnaie dans laquelle la jambe 2 du contrat d'échange est libellée.</p> <p>Ce champ ne doit être rempli que s'il y a des contrats dérivés sur taux d'intérêt et sur devises.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Expression du prix	Indique la manière dont le prix est exprimé: en valeur monétaire, en pourcentage, en taux de rendement ou en points de base.	<p>«MONE» — Valeur monétaire</p> <p>«PERC» — Pourcentage</p> <p>«YIEL» — Rendement</p> <p>«BAPO» — Points de base</p>

Section J — Instructions de l'ordre

32	Indicateur achat-vente	<p>Pour indiquer s'il s'agit d'un ordre d'achat ou d'un ordre de vente</p> <p>Dans le cas des options et des options d'échange (swaptions), l'acheteur est la contrepartie qui détient le droit d'exercer l'option et le vendeur est la contrepartie qui vend l'option et reçoit une prime.</p> <p>Dans le cas des «futures» (contrats à terme négociés sur un marché réglementé), des «forwards» (contrats à terme négociés de gré à gré) autres que les «futures», et des «forwards» portant sur des devises, l'acheteur est la contrepartie qui achète l'instrument et le vendeur la contrepartie qui vend l'instrument.</p> <p>Dans le cas des contrats d'échange portant sur des titres, l'acheteur est la contrepartie qui accepte le risque de variation du prix du titre sous-jacent et reçoit le montant du titre. Le vendeur est la contrepartie qui paie le montant du titre.</p>	<p>«BUYI» — achat</p> <p>«SELL» — vente</p>
----	------------------------	--	---

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
		<p>Dans le cas des contrats d'échange portant sur des taux d'intérêt ou des indices d'inflation, l'acheteur est la contrepartie qui paie le taux fixe. Le vendeur est la contrepartie qui reçoit le taux fixe. Dans le cas des contrats d'échange taux d'intérêt variable contre taux d'intérêt variable (basis swap), l'acheteur est la contrepartie qui paie l'écart de taux et le vendeur est la contrepartie qui reçoit l'écart de taux.</p> <p>Dans le cas des contrats d'échanges et des contrats à terme «forwards» portant sur des devises et dans le cas des crédits croisés, l'acheteur est la contrepartie qui reçoit la devise dont le code ISO 4217 vient en premier dans l'ordre alphabétique et le vendeur est la contrepartie qui livre cette devise.</p> <p>Dans le cas de contrats d'échange portant sur des dividendes, l'acheteur est la contrepartie qui reçoit l'équivalent des dividendes effectivement distribués. Le vendeur est la contrepartie qui paie le dividende et reçoit le taux fixe.</p> <p>Dans le cas des instruments dérivés servant au transfert de risque de crédit, à l'exception des options et des options sur swaps, l'acheteur est la contrepartie qui achète la protection. Le vendeur est la contrepartie qui vend la protection.</p> <p>Dans le cas des contrats dérivés portant sur des matières premières ou des quotas d'émission, l'acheteur est la contrepartie qui reçoit la matière première ou le quota d'émission indiqués dans le rapport et le vendeur est la contrepartie qui livre cette matière première ou ce quota d'émission.</p> <p>Dans le cas des accords de taux futurs, l'acheteur est la contrepartie qui paie le taux fixe et le vendeur la contrepartie qui reçoit le taux fixe.</p> <p>Pour une augmentation du notionnel, l'acheteur correspond à l'acquéreur de l'instrument financier dans la transaction initiale et le vendeur correspond à la partie qui cède l'instrument financier dans la transaction initiale.</p> <p>Pour une baisse du notionnel, l'acheteur correspond à la partie qui cède l'instrument financier dans la transaction initiale et le vendeur correspond à l'acquéreur de l'instrument financier dans la transaction initiale.</p>	
33	Statut de l'ordre	<p>Pour identifier les ordres qui sont actifs/inactifs/suspendus, fermes/indicatifs (attribué uniquement aux offres de prix ou «quotes»)/implicites/réacheminés.</p> <p>Actif — ordres exécutables autres que les offres de prix.</p> <p>Inactif — ordres non exécutables autres que les offres de prix.</p> <p>Fermes/indicatifs — attribué uniquement aux offres de prix. Les offres de prix sont dites indicatives lorsqu'elles sont visibles mais ne peuvent pas être exécutées. Cela inclut les warrants sur certaines plateformes de négociation. Les offres de prix fermes peuvent être exécutées.</p> <p>Implicites — Utilisé pour les ordres de stratégie (strategy orders) qui résultent de la fonction «implied in» ou «implied out».</p> <p>Acheminé — Utilisé pour les ordres qui sont acheminés par la plate-forme de négociation vers d'autres plates-formes.</p>	<p>«ACTI» — actif</p> <p>ou</p> <p>«INAC» — inactif</p> <p>ou</p> <p>«FIRM» — offres de prix fermes</p> <p>ou</p> <p>«INDI» — offres de prix indicatives</p> <p>ou</p> <p>«IMPL» — ordres de stratégie implicites</p> <p>ou</p> <p>«ROUT» — ordres acheminés.</p> <p>Si plusieurs statuts s'appliquent, il convient d'indiquer dans ce champ plusieurs codes signalétiques séparés par des virgules.</p>

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
34	Expression de la quantité	Indique la manière dont la quantité est exprimée: en nombre d'unités, en valeur nominale ou en valeur monétaire.	«UNIT» — Nombre d'unités «NOML» — Valeur nominale «MONE» — Valeur monétaire
35	Monnaie de la quantité	Monnaie dans laquelle la quantité est exprimée. Ce champ ne doit être rempli que si la quantité est exprimée en valeur nominale ou en valeur monétaire.	{CURRENCYCODE_3}
36	Quantité initiale	Le nombre d'unités de l'instrument financier ou le nombre de contrats dérivés sur lesquels porte l'ordre. La valeur nominale ou monétaire de l'instrument financier. Pour les contrats permettant de miser sur un écart (spread bets), la quantité est égale à la valeur monétaire de la mise par point de variation de l'instrument financier sous-jacent. Pour une augmentation ou diminution du notionnel des contrats dérivés, le nombre reflète la valeur absolue de la variation et est exprimé sous la forme d'un nombre positif. Pour les contrats d'échange sur risque de défaut, la quantité est le montant notionnel pour lequel la protection est acquise ou cédée.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.
37	Quantité résiduelle, y compris cachée	La quantité totale qui reste dans le carnet d'ordres après une exécution partielle ou dans le cas de tout autre événement affectant l'ordre. En cas d'ordre partiellement exécuté, il s'agit du solde non exécuté. Lors de l'entrée de l'ordre, elle sera égale à la quantité initiale.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.
38	Quantité affichée	La quantité qui est visible (par opposition à cachée) dans le carnet d'ordres.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.
39	Quantité exécutée	Lorsqu'il y a exécution partielle ou intégrale, il convient d'indiquer dans ce champ la quantité exécutée.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.
40	Quantité acceptable minimale (QAM)	La quantité acceptable minimale pour qu'un ordre soit exécuté, qui peut correspondre à plusieurs exécutions partielles et ne s'applique en principe qu'aux types d'ordres non persistants. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
41	Taille exécutable minimale (TEM)	La taille minimale de toute exécution individuelle potentielle. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités. {DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.
42	TEM seulement pour la première exécution	Indique si la taille exécutable minimale ne concerne que la première exécution. Ce champ peut être laissé vide si le champ 41 est laissé vide.	«vrai» «faux»
43	Indicateur passif seulement	Indique si l'ordre est soumis à la plateforme de négociation avec une caractéristique/un code signalétique faisant qu'il ne sera pas exécuté immédiatement contre un éventuel ordre visible de sens contraire.	«vrai» «faux»
44	Indicateur passif ou agressif	En cas d'exécution partielle ou intégrale d'un ordre, indique si cet ordre était déjà présent dans le carnet d'ordres et apportait de la liquidité (passif) ou si l'ordre a déclenché la transaction et a donc consommé de la liquidité (agressif). Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	«PASV» — passif ou «AGRE» — agressif.
45	Prévention de l'auto-exécution	Indique si l'ordre a été placé avec un critère de prévention de l'auto-exécution empêchant qu'il soit exécuté contre un ordre de sens opposé dans le carnet d'ordres placé par le même membre ou participant.	«vrai» «faux»
46	Identification des ordres liés à une stratégie	Le code alphanumérique qui sert à relier tous les ordres liés s'inscrivant dans une même stratégie au sens de l'article 7, paragraphe 2.	{ALPHANUM-50}
47	Stratégie de routage	La stratégie de routage applicable selon les spécifications de la plate-forme de négociation. Ce champ est laissé vide lorsqu'il n'est pas pertinent.	{ALPHANUM-50}
48	Code d'identification de transaction de la plate-forme de négociation	Code alphanumérique attribué à la transaction par la plateforme de négociation conformément à l'article 12 de ce règlement. Le code d'identification de transaction de la plate-forme de négociation est un code unique, cohérent et persistant pour chaque MIC de segment selon ISO10383 et pour chaque séance. Lorsque la plate-forme de négociation n'utilise pas les MIC de segment, le code d'identification de transaction de la plate-forme de négociation est unique, cohérent et persistant pour chaque MIC d'exploitation et pour chaque séance. Les éléments composant le code d'identification de transaction ne révèlent pas l'identité des contreparties à la transaction à laquelle il est attribué.	{ALPHANUM-52}

N.	Champ	Contenu des renseignements sur les ordres qui doivent être tenus à la disposition de l'autorité compétente	Normes et formats des renseignements sur les ordres pour la communication à la demande de données sur les ordres à l'autorité compétente
----	-------	--	--

Section K — phases de négociation, cours et volume de fixing indicatifs

49	Phases de négociation	Le nom de chacune des différentes phases de négociation au cours desquelles un ordre est présent dans le carnet d'ordres, y compris les interruptions de négociation, les coupe-circuit et les suspensions.	{ALPHANUM-50}
50	Cours de fixing indicatif	Le cours auquel le fixing devrait conduire pour l'instrument financier faisant l'objet d'un ou plusieurs ordres.	<p>{DECIMAL-18/5} lorsque le prix est exprimé sous forme de valeur monétaire ou nominale.</p> <p>Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure.</p> <p>{DECIMAL-11/10} lorsque le prix est exprimé sous la forme d'un pourcentage ou d'un rendement.</p>
51	Volume de fixing indicatif	Le volume (nombre d'unités de l'instrument financier) qui peut être exécuté au cours de fixing indicatif indiqué dans le champ 50 si le fixing prend fin à ce moment précis.	<p>{DECIMAL-18/17} lorsque la quantité est exprimée en nombre d'unités.</p> <p>{DECIMAL-18/5} lorsque la quantité est exprimée en valeur monétaire ou nominale.</p>