



Bruxelles, le 1.3.2016
C(2016) 1224 final

ANNEX 1

ANNEXES

**au règlement délégué de la Commission complétant le règlement (UE) n° 596/2014 du
Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation
concernant le contenu des notifications à adresser aux autorités compétentes et la
compilation, la publication et la tenue de la liste de ces notifications**

ANNEXES

au règlement délégué de la Commission complétant le règlement (UE) n° 596/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant le contenu des notifications à adresser aux autorités compétentes et la compilation, la publication et la tenue de la liste de ces notifications

Notification d'instruments financiers conformément à l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 596/2014

Tableau 1

*Classification des instruments dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission pour le
tableau 2 (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)
	«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» – Naphtha «NGLO» – Liquides de gaz naturel (LGN) «TAPI» – Tapis «URAL» – Urals «WTIO» – West Texas Intermediate (WTI)
	«COAL» – Charbon «INRG» – Interénergies «RNG» – 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	
«FRGT» – Fret	«WETF» – Vrac liquide	«TNKR» – Tankers
	«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 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, section «Autres instruments dérivés C10», 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	«DLVR» – Livrables «NDLV» – Non livrables	

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.		
«OTHR» – Autres		

Tableau 2
Contenu des notifications à présenter aux autorités compétentes conformément à l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 596/2014

N°	CHAMP	INFORMATIONS À DÉCLARER
Champs généraux		
1	Code d'identification de l'instrument	Code utilisé pour identifier l'instrument financier.
2	Nom complet de l'instrument	Nom complet de l'instrument financier.
3	Classement de l'instrument	Taxonomie utilisée pour classer l'instrument financier. Un code complet et exact de la classification ISO des instruments financiers (code CFI) doit être fourni.
4	Indicateur d'instruments dérivés sur matières premières	Indiquer si l'instrument financier relève de la définition des instruments dérivés sur matières premières figurant à l'article 2, paragraphe 1, point 30, du règlement (UE) n° 600/2014.
Champs concernant l'émetteur		
5	Identifiant de l'émetteur ou de l'opérateur de la plate-forme négociation	Identifiant d'entité juridique (LEI) de l'émetteur ou de l'exploitant de la plate-forme de négociation.
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>).
7	Nom abrégé de l'instrument financier	Nom abrégé de l'instrument financier conformément à la norme ISO 18774.

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.
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.
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.
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.
12	Date de cessation	Date et heure auxquelles l'instrument financier cesse d'être négocié ou d'être admis à la négociation sur la plate-forme de négociation. Si la date et l'heure ne sont pas connues, le champ ne doit pas être rempli.
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, il s'agira de la monnaie du notionnel de la jambe 1 ou de 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, il s'agira de la monnaie du notionnel du contrat d'échange sous-jacent. Pour les options d'échange fondées sur un contrat d'échange sous-jacent multidevises, il s'agira de la monnaie du notionnel de la jambe 1 du contrat d'échange.

Champs concernant les obligations ou autres titres de créance

14	Montant nominal émis total	Montant nominal émis total, exprimé en valeur monétaire.
15	Date d'échéance	Date d'échéance de l'instrument financier déclaré. Ce champ s'applique aux titres de créance à échéance définie.
16	Monnaie de la valeur nominale	Monnaie de la valeur nominale pour les titres de créance.
17	Valeur nominale unitaire/valeur négociée minimale	Valeur nominale de chaque instrument. Si elle n'est pas connue, indiquer la valeur négociée minimale.
18	Taux fixe	Pourcentage de rendement à taux fixe sur un titre de créance détenu jusqu'à l'échéance, exprimé sous forme de pourcentage.
19	Identifiant de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	Si un tel identifiant existe.
20	Nom de l'indice/indice de référence d'une obligation à taux variable	Si aucun identifiant n'existe, nom de l'indice.
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.

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.
23	Rang de l'obligation	Indiquer le type d'obligation: dette de premier rang (<i>senior</i>), mezzanine, subordonnée ou de rang inférieur (<i>junior</i>).
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.
25	Multiplicateur du prix	<p>Nombre d'unités de l'instrument sous-jacent représentées par un même contrat dérivé.</p> <p>Pour un contrat à terme ou une option sur indice, indiquer le montant par point d'indice.</p> <p>Pour les spéculations sur écarts financiers, indiquer la fluctuation du prix de l'instrument sous-jacent sur lequel la spéculation sur écart financier est basée.</p>
26	Code de l'instrument sous-jacent	<p>Code ISIN (International Securities Identification Number – numéro international d'identification des titres) de l'instrument sous-jacent.</p> <p>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.</p> <p>Pour les obligations convertibles, indiquer le code ISIN de l'instrument en lequel l'obligation peut être convertie.</p> <p>Pour les instruments dérivés ou les autres</p>

		<p>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 d'instrument des actions concernées donnant droit aux dividendes sous-jacents.</p> <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. Par conséquent, les champs 26 et 27 doivent être remplis autant de fois que nécessaire pour reprendre tous les instruments compris dans le panier.</p>
27	Émetteur du sous-jacent	Si l'instrument renvoie à un émetteur plutôt qu'à un instrument unique, indiquer le code LEI de l'émetteur.
28	Nom de l'indice sous-jacent	Si le sous-jacent est un indice, indiquer le nom de l'indice.
29	Durée de l'indice sous-jacent	Si le sous-jacent est un indice, indiquer la durée de l'indice.
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 s'il est impossible de déterminer s'il s'agit d'une option d'achat ou d'une option de vente au moment de l'exécution. En ce qui concerne les options d'échange, il s'agit:</p> <p>- d'une «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</p>

		<p>d'échange en tant que receveur de taux fixe;</p> <ul style="list-style-type: none"> - d'une «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, il s'agit:</p> <ul style="list-style-type: none"> - d'une «option de vente» si un plancher est prévu; - d'une «option d'achat» si un plafond est prévu. <p>Ce champ ne s'applique qu'aux instruments dérivés qui sont des options ou des bons de souscription d'actions (<i>warrants</i>).</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 s'applique qu'aux options ou aux 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>Si le prix d'exercice ne s'applique pas, le champ ne doit pas être rempli.</p>
32	Monnaie du prix d'exercice	Monnaie du prix d'exercice.
33	Modalités d'exercice de l'option	<p>Indiquer si l'option peut être exercée à une date fixe uniquement (option européenne ou asiatique), à différentes dates prédéterminées (option bermudienne) ou à n'importe quel moment de la vie du contrat (option américaine).</p> <p>Ce champ s'applique uniquement aux options, aux bons de souscription d'actions et aux certificats de droits (<i>«entitlement certificates»</i>).</p>
34	Modalités de livraison	<p>Indiquer si l'instrument financier est réglé physiquement ou en espèces.</p> <p>Si le type de livraison ne peut être déterminé au moment de l'exécution, la valeur à indiquer est «OPTL».</p>

		Ce champ s'applique uniquement aux instruments dérivés.
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.
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».
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».
38	Type de transaction	Type de transaction, tel que précisé par la plate-forme de négociation.
39	Type de prix final	Type de prix final, tel que précisé par la plate-forme de négociation.
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	Nom du taux de référence.
41	Durée du contrat (taux d'intérêt)	Si l'actif relève de la catégorie des taux d'intérêt, ce champ sert à indiquer la durée du contrat. La durée doit être exprimée en jours, semaines, mois ou années.
42	Monnaie du	Pour les contrats d'échange multidevises ou les crédits croisés, indiquer la monnaie dans

	notionnel 2	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.
43	Taux fixe de la jambe 1	Indication du taux fixe de la jambe 1 utilisé, s'il y a lieu.
44	Taux fixe de la jambe 2	Indication du taux fixe de la jambe 2 utilisé, s'il y a lieu.
45	Taux variable de la jambe 2	Indication du taux d'intérêt utilisé, s'il y a lieu.
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 des intervalles prédéterminés par rapport à un taux de référence du marché. La durée doit être exprimée en jours, semaines, mois ou années.
<p>Dérivés de change - Les champs de cette section doivent uniquement être remplis pour les instruments ayant pour sous-jacent un instrument non financier de change.</p>		
47	Monnaie du notionnel 2	Le champ doit être rempli en indiquant la monnaie sous-jacente 2 de la paire de monnaies (la monnaie 1 sera indiquée dans le champ 13, «Monnaie du notionnel 1»).
48	Type de change	Type de monnaie sous-jacente.