

Bruxelles, le 14 juillet 2026
(OR. en)

11909/26
ADD 1

EF 209
ECOFIN 1019
DELECT 115

NOTE DE TRANSMISSION

Origine:	Pour la secrétaire générale de la Commission européenne, Madame Martine DEPREZ, directrice
Date de réception:	13 juillet 2026
Destinataire:	Madame Thérèse BLANCHET, secrétaire générale du Conseil de l'Union européenne
N° doc. Cion:	C(2026) 4777 annex
Objet:	ANNEXES du RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) .../... DE LA COMMISSION modifiant les normes techniques de réglementation définies par le règlement délégué (UE) 2017/583 en ce qui concerne les obligations de transparence applicables aux plates-formes de négociation et aux entreprises d'investissement pour les produits dérivés, le règlement délégué (UE) 2017/2194 en ce qui concerne les paquets d'ordres et le règlement délégué (UE) 2025/1155 en ce qui concerne les données d'entrée et de sortie du système consolidé de publication pour les produits dérivés de gré à gré, et rectifiant le règlement délégué (UE) 2017/587 de la Commission

Les délégations trouveront ci-joint le document C(2026) 4777 annex.

p.j.: C(2026) 4777 annex



COMMISSION
EUROPÉENNE

Bruxelles, le 13.7.2026
C(2026) 4777 final

ANNEXES 1 to 3

ANNEXES

du

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) .../... DE LA COMMISSION

modifiant les normes techniques de réglementation définies par le règlement délégué (UE) 2017/583 en ce qui concerne les obligations de transparence applicables aux plates-formes de négociation et aux entreprises d'investissement pour les produits dérivés, le règlement délégué (UE) 2017/2194 en ce qui concerne les paquets d'ordres et le règlement délégué (UE) 2025/1155 en ce qui concerne les données d'entrée et de sortie du système consolidé de publication pour les produits dérivés de gré à gré, et rectifiant le règlement délégué (UE) 2017/587 de la Commission

ANNEXE I

Le règlement délégué (UE) 2017/583 est modifié comme suit:

(1) à l'annexe II, les tableaux 2 et 3 sont remplacés par les tableaux suivants:

«Tableau 2

Informations détaillées aux fins de la transparence post-négociation

Le nom de chaque champ (en-tête de colonne) tel que publié doit être identique à l'intitulé du champ indiqué dans le tableau 2.

#	Intitulé du champ	Instruments financiers	Description et informations à publier	Type de lieu d'exécution ou de publication	Format à employer, tel qu'indiqué dans le tableau 1
1.	Date et heure de la transaction	Pour tous les instruments financiers	La date et l'heure auxquelles la transaction a été exécutée. Pour les transactions exécutées sur une plate-forme de négociation, le niveau de granularité doit être conforme aux exigences énoncées à l'article 12 du règlement délégué (UE) 2025/1155 de la Commission ¹ . Pour les transactions non exécutées sur une plate-forme de négociation, la date et l'heure auxquelles les parties ont convenu de ce qui est indiqué dans les champs suivants: quantité, prix, monnaies, comme précisé dans les champs 31, 34 et 44 du tableau 2 de	Marché réglementé (RM) Système multilatéral de négociation (MTF) Système	{DATE_TIME_FORMAT}

¹ Règlement délégué (UE) 2025/1155 de la Commission du 12 juin 2025 complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les données d'entrée et de sortie des systèmes consolidés de publication, la synchronisation des horloges professionnelles et la redistribution des recettes par le fournisseur de système consolidé de publication pour les actions et les fonds cotés, et abrogeant le règlement délégué (UE) 2017/574 de la Commission (JO L, 2025/1155, 3.11.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

			l'annexe I du règlement délégué (UE) 2017/590 de la Commission ² , code d'identification de l'instrument, catégorie de l'instrument et code de l'instrument sous-jacent, le cas échéant. Pour les transactions non exécutées sur une plate-forme de négociation, le degré de précision de l'heure déclarée doit être au moins à la seconde près. Lorsque la transaction résulte d'un ordre transmis par l'entreprise chargée de l'exécution à un tiers pour le compte d'un client et que les conditions de transmission définies à l'article 4 du règlement délégué (UE) 2017/590 ne sont pas satisfaites, la date et l'heure de la transaction elle-même et non celles de la transmission de l'ordre.	organisé de négociation (OTF) Dispositif de publication agréé (APA)	
2.	Code d'identification de l'instrument	Pour tous les instruments financiers	Le code utilisé pour identifier l'instrument financier. Pour les produits dérivés de gré à gré visés à l'article 8 <i>bis</i> , paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014, l'identification de l'instrument s'effectue conformément au règlement délégué (UE) 2025/1003 de la Commission ³ .	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN} sauf pour les produits dérivés de gré à gré visés à l'article 8 <i>bis</i> , paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014.
2a.	Date de prise	Pour les dérivés de taux d'intérêt de gré à	La date de prise d'effet des obligations découlant du	MTF, OTF,	{DATEFORMAT}

² 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 (JO L 87 du 31.3.2017, p. 449, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/590/oj).

³ Règlement délégué (UE) 2025/1003 de la Commission du 24 janvier 2025 complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les données de référence identifiantes des produits dérivés de gré à gré à utiliser aux fins du respect des obligations de transparence prévues à l'article 8 *bis*, paragraphe 2, et aux articles 10 et 21 (JO L, 2025/1003, 22.5.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1003/oj).

	d'effet	gré	contrat dérivé de taux d'intérêt.	APA	
2b.	Date d'expiration	Pour les dérivés de taux d'intérêt de gré à gré	La date d'expiration du contrat dérivé de taux d'intérêt.	MTF, OTF, APA	{DATEFORMAT}
3.	Prix	Pour tous les instruments financiers	Le prix d'exécution de la transaction, le cas échéant hors commission et intérêts courus. Le prix d'exécution est indiqué conformément aux conventions d'usage sur le marché. La valeur indiquée dans ce champ doit concorder avec la valeur indiquée dans le champ "Expression du prix". Lorsque le prix n'est pas encore disponible mais en attente ("PNDG"), ou sans objet ("NOAP"), ne pas remplir ce champ.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13} si le prix est exprimé en valeur monétaire {DECIMAL-11/10} si le prix est exprimé en pourcentage ou en taux de rendement {DECIMAL-18/17} si le prix est exprimé en points de base
4.	Prix manquant	Pour tous les instruments financiers	Lorsque le prix n'est pas encore disponible, la valeur à indiquer est "PNDG" ("en attente"). Lorsque le prix est sans objet, indiquer "NOAP" (<i>not applicable</i>).	RM, MTF, OTF, APA	"PNDG" si le prix n'est pas disponible "NOAP" si le prix est sans objet
5.	Monnaie du prix	Pour tous les instruments financiers	La monnaie majeure dans laquelle est exprimé le prix (applicable si le prix est exprimé en valeur monétaire).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6.	Expression du prix	Pour tous les instruments financiers	La manière dont le prix est exprimé: en valeur monétaire, en pourcentage, en points de base ou en taux de rendement. L'expression du prix est indiquée conformément aux conventions d'usage sur le marché.	RM, MTF, OTF, APA	"MONE" — Valeur monétaire "PERC" — Pourcentage "YIEL" — Rendement "BAPO" — Points de base

			Pour les contrats d'échange sur risque de crédit, il convient d'indiquer dans ce champ "BAPO". Pour les obligations (autres que les ETN et les ETC), il convient d'indiquer dans ce champ le pourcentage (PERC) du montant notionnel. Lorsque l'expression du prix en pourcentage ne correspond pas aux conventions d'usage sur le marché, il convient d'indiquer à la place les valeurs YIEL, BAPO ou MONE, selon les conventions d'usage sur le marché. La valeur fournie dans ce champ doit concorder avec celle indiquée dans le champ "Prix". Lorsque le prix est indiqué sous forme monétaire, il est donné dans l'unité monétaire majeure. Lorsque le prix n'est pas disponible mais en attente ("PNDG"), ou sans objet ("NOAP"), ne pas remplir ce champ.		
7.	Quantité	Pour tous les instruments financiers	Pour les instruments financiers négociés en unités, le nombre d'unités de l'instrument financier. Dans les autres cas, vide.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
8.	Quantité unités mesure	Pour les contrats établis en unités de dérivés sur matières premières, dérivés C10, dérivés sur quotas d'émission et quotas d'émission	La quantité équivalente de matières premières ou quotas d'émission négociés, exprimée en unités de mesure.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}

9.	Expression de la quantité en unités de mesure	Pour les contrats établis en unités de dérivés sur matières premières, dérivés C10, dérivés sur quotas d'émission et quotas d'émission	L'unité de mesure dans laquelle est exprimée la quantité.	RM, MTF, OTF, APA	“TOCD” — tonnes équivalent dioxyde de carbone, pour tout contrat lié aux quotas d'émission “TONE” — tonnes métriques “MWHO” — mégawattheures “MBTU” — un million de British Thermal Units “THMS” — therms “DAYS” — jours, ou {ALPHANUM-4} dans les autres cas
10.	Montant notionnel	Pour tous les instruments financiers	Il convient d'indiquer dans ce champ: (i) pour les obligations (à l'exclusion des ETC et des ETN), la valeur nominale, c'est-à-dire le montant reversé à l'investisseur au moment du remboursement; (ii) pour les ETC, les ETN et les dérivés titrisés, le nombre d'instruments échangés entre les acheteurs et les vendeurs, multiplié par le prix de l'instrument échangé pour cette transaction spécifique. Cela équivaut au champ Prix multiplié par le champ Quantité; (iii) pour les produits financiers structurés (PFS), la valeur nominale par unité multipliée par le nombre d'instruments au	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

			moment de la transaction; (iv) pour les contrats d'échange sur risque de crédit (CDS), le montant notionnel pour lequel la protection est acquise ou cédée; (v) pour les options, les options d'échange (swaptions), les swaps autres que ceux visés au point iv), les <i>futures</i> et les <i>forwards</i>, le montant notionnel du contrat; (vi) pour les quotas d'émission, le produit de la quantité par le prix fixé dans le contrat au moment de la transaction. Cela équivaut au champ Prix multiplié par le champ Quantité en unités de mesure; (vii) pour les contrats permettant de miser sur un écart (<i>spread bets</i>), la valeur monétaire de la mise par point de variation de l'instrument financier sous-jacent au moment de la transaction; (viii) pour les contrats financiers pour différences, le nombre d'instruments échangés entre les acheteurs et les vendeurs multiplié par le prix de l'instrument échangé pour cette transaction spécifique. Cela équivaut au champ Prix multiplié par le champ Quantité.		
11.	Monnaie du notionnel	Pour tous les instruments financiers	L'unité monétaire majeure dans laquelle est libellé le montant notionnel. Dans le cas d'un contrat dérivé de change, d'un swap multidevises ou d'une option d'échange (swaption) dont le swap sous-jacent est un swap multidevises,	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}

			d'un CFD sur devises ou d'un contrat permettant de miser sur un écart (<i>spread betting contract</i>), il s'agira de la monnaie du notionnel de la jambe 1.		
12.	[supprimé]				
13.	Lieu d'exécution	Pour tous les instruments financiers	Le lieu où la transaction a été exécutée. Utiliser le code MIC du segment de marché pour les transactions exécutées sur une plate-forme de négociation de l'UE. S'il n'existe pas de code MIC du segment de marché, utiliser le code MIC d'exploitation (<i>operating MIC</i>). Utiliser "SINT" pour les instruments financiers admis à la négociation ou négociés sur une plate-forme de négociation, lorsque la transaction sur cet instrument financier est exécutée par un internalisateur systématique. Utiliser le code MIC "XOFF" pour les instruments financiers admis à la négociation ou négociés sur une plate-forme de négociation, lorsque la transaction sur cet instrument financier n'est exécutée ni sur une plate-forme de négociation de l'UE, ni par un internalisateur systématique. Si la transaction est exécutée sur une plate-forme de négociation organisée en dehors de l'UE, utiliser "XOFF" et compléter en outre le champ "Plate-forme de négociation de pays tiers utilisée pour l'exécution".	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – plates-formes de négociation de l'UE, ou "SINT" – internalisateur systématique "XOFF" – dans les autres cas
14.	Plate-forme de négociation de	Pour tous les instruments financiers	La plate-forme de négociation de pays tiers où la transaction a été exécutée.	APA	{MIC}

	pays tiers utilisée pour l'exécution		Utiliser le code MIC du segment de marché. S'il n'existe pas de code MIC du segment de marché, utiliser le code MIC d'exploitation (<i>operating MIC</i>). Si la transaction n'est pas exécutée sur une plate-forme de négociation d'un pays tiers, ne pas remplir ce champ.		
15.	Date et heure de la publication	Pour tous les instruments financiers	La date et l'heure auxquelles la transaction a été publiée par une plate-forme de négociation ou un APA. Pour les transactions exécutées sur une plate-forme de négociation, le niveau de granularité doit être conforme aux exigences énoncées à l'article 12 du règlement délégué (UE) 2025/1155. Pour les transactions non exécutées sur une plate-forme de négociation, le degré de précision de l'heure déclarée doit être au moins à la seconde près.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_FORMAT}
16.	Lieu de publication	Pour tous les instruments financiers	Le code d'identification de la plate-forme de négociation ou de l'APA publiant la transaction.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17.	Code d'identification de la transaction	Pour tous les instruments financiers	Le code alphanumérique attribué à une transaction donnée par les plates-formes de négociation [en vertu de l'article 12 du règlement délégué (UE) 2017/580 de la Commission ⁴] et les APA, et utilisé ultérieurement pour toute référence à cette	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}

⁴ 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 (JO L 87 du 31.3.2017, p. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

			transaction.		
18.	[supprimé]				
19.	Codes signalétiques	Pour tous les instruments financiers	Compléter un ou plusieurs champs avec les codes signalétiques applicables tels que décrits dans le tableau 3 de l'annexe II. Lorsqu'aucune des circonstances spécifiées ne s'applique, la transaction est publiée sans code signalétique. Lorsque plusieurs codes signalétiques sont possibles et qu'ils sont saisis dans un même champ, ils doivent être séparés par une virgule.	RM, MTF, OTF, APA	Conformément à l'annexe II, tableau 3
20.	Système de négociation	Pour tous les instruments financiers	Le type de système de négociation sur lequel la transaction est exécutée. Lorsque le champ "Lieu d'exécution" est complété par "SINT" ou "XOFF", ce champ ne doit pas être rempli.	RM, MTF, OTF	"CLOB" – système de négociation à carnet central d'ordres à cours limité "QDTS" – système de négociation dirigé par les prix, c'est-à-dire un système dans lequel les transactions sont conclues sur la base d'offres de prix fermes qui sont en permanence communiquées aux participants, ce qui nécessite que le teneur de marché propose en permanence des prix pour une certaine quantité qui, tout en répondant aux besoins des membres et des participants en termes de taille commerciale, tienne également compte du risque auquel il s'expose "PATS" – système de négociation à

					enchères périodiques “RFQT” – système de négociation avec demandes d’offre de prix, c’est-à-dire un système de négociation dans lequel une ou plusieurs offres de prix sont présentées en réponse à une demande d’offre soumise par un ou plusieurs autres membres ou participants. L’offre ne peut être exécutée que par le membre ou participant au marché qui a soumis la demande. Celui-ci peut conclure une transaction en acceptant la ou les offres qui lui ont été fournies à sa demande. “VOIC” – système de négociation à la criée, c’est-à-dire un système de négociation dans lequel les transactions entre les membres sont négociées oralement “HYBR” – système de négociation hybride, c’est-à-dire un système relevant d’au moins deux des types de systèmes de négociation susmentionnés “OTHR” – tout autre système de négociation, c’est-à-dire tout autre type de système de négociation non cité ci-
--	--	--	--	--	--

					dessus.
21.	Nombre de transactions	Pour les instruments de dette souveraine	Il convient d'indiquer dans ce champ le nombre de transactions exécutées lorsque la publication différée des détails de plusieurs transactions sous une forme agrégée est requise en vertu de l'article 11, paragraphe 3, point b), du règlement (UE) n° 600/2014.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}

Tableau 3
Codes signalétiques utilisés aux fins de la transparence post-négociation

CODES SIGNALÉTIQUES DE PUBLICATION DIFFÉRÉE POST-NÉGOCIATION POUR LES OBLIGATIONS (À L'EXCLUSION DES ETC ET DES ETN) ET POUR CERTAINS DÉRIVÉS			
Code signalétique	Nom	Type de lieu d'exécution ou de publication	Description
MLF1	Code signalétique «taille moyenne, liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille moyenne sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point a), du présent règlement. Les transactions sur des produits dérivés bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille moyenne sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.

MIF2	Code signalétique «taille moyenne, non liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille moyenne sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point b), du présent règlement. Les transactions sur des produits dérivés bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille moyenne sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.
LLF3	Code signalétique «taille élevée, liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point c), du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de crédit bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de taux d'intérêt bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée/très élevée sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.
LIF4	Code signalétique «taille élevée, non liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point d), du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de crédit bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de taux d'intérêt bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille élevée/très élevée sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.

VLF5	Code signalétique «taille très élevée, liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille très élevée sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point e), du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de crédit bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille très élevée sur un instrument financier pour lequel il existe un marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.
VIF5	Code signalétique «taille très élevée, non liquide»	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des obligations bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille très élevée sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 1, point e), du présent règlement. Les transactions sur des dérivés de crédit bénéficiant du report de publication applicable aux transactions de taille très élevée sur un instrument financier pour lequel il n'existe pas de marché liquide, conformément à l'article 8 du présent règlement.

CODES SIGNALÉTIQUES DE PUBLICATION DIFFÉRÉE POST-NÉGOCIATION POUR LES ETC, LES ETN, LES PFS, LES QUOTAS D'ÉMISSION ET CERTAINS DÉRIVÉS			
Code signalétique	Nom	Type de lieu d'exécution ou de publication	Description
DEFF	Publication différée pour les ETC, les ETN, les PFS, les quotas d'émission et certains dérivés	RM, MTF, OTF, APA	Les transactions sur des ETC, des ETN, des PFS et des quotas d'émission bénéficiant d'un report de publication tel que prévu à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphes 2 et 3, du présent règlement. Les transactions sur des dérivés bénéficiant du report de publication applicable aux transactions pour lesquelles une seule taille est possible pour un report.

CODES SIGNALÉTIQUES DE REPORT DE PUBLICATION SUPPLÉMENTAIRE POUR LES OBLIGATIONS SOUVERAINES				
Article 11, paragraphe 3, point a)	“OMIS”	Code signalétique pour omission du volume	RM, MTF, OTF, APA	Transaction pour laquelle des informations limitées sont publiées conformément à l’article 11, paragraphe 3, point a), du règlement (UE) n° 600/2014.
	“FULO”	Code signalétique pour informations complètes	RM, MTF, OTF, APA	Transaction pour laquelle des informations limitées ont précédemment été publiées conformément à l’article 11, paragraphe 3, point a), du règlement (UE) n° 600/2014.
Article 11, paragraphe 3, point b)	“AGFW”	Code signalétique pour agrégation quatre semaines	RM, MTF, OTF, APA	Publication de transactions sous forme d’agrégats conformément à l’article 11, paragraphe 3, point b), du règlement (UE) n° 600/2014.
	“FULG”	Code signalétique pour informations complètes	RM, MTF, OTF, APA	Transactions individuelles qui ont précédemment bénéficié de la publication sous forme d’agrégats conformément à l’article 11, paragraphe 3, point b), du règlement (UE) n° 600/2014.

AUTRES CODES SIGNALÉTIQUES			
Code signalétique	Nom	Type de lieu d’exécution ou de publication	Description
“BENC”	Code signalétique pour les transactions basées sur un indice	RM, MTF, OTF, APA	Transactions exécutées sur la base d’un cours calculé sur plusieurs instants en fonction d’un indice de référence donné, tel que le cours moyen pondéré par volume ou le cours moyen pondéré dans le temps.

	de référence		
“NPFT”	Code signalétique pour les transactions ne contribuant pas à la formation des prix	RM, MTF, OTF, APA	Transactions ne contribuant pas à la formation des prix au sens de l’article 2, paragraphe 5, du règlement délégué (UE) 2017/590.
“TPAC”	Code signalétique pour les paquets de transactions	RM, MTF, OTF, APA	Les paquets de transactions qui ne sont pas des échanges physiques pour contrats (EFP), au sens de l’article 2, paragraphe 1, point 50), b), du règlement (UE) n° 600/2014.
“XFPH”	Code signalétique pour les transactions EFP	RM, MTF, OTF, APA	Échange physique pour contrats, au sens de l’article 2, paragraphe 1, point 48), du règlement (UE) n° 600/2014.
“CANC”	Code signalétique pour les transactions annulées	RM, MTF, OTF, APA	Utilisé lorsqu’une transaction précédemment publiée est annulée.
“AMND”	Code signalétique pour les transactions modifiées	RM, MTF, OTF, APA	Utilisé lorsqu’une transaction précédemment publiée est modifiée.
“PORT”	Code signalétique pour les négociations de portefeuille	RM, MTF, OTF, APA	Une transaction portant sur au moins cinq instruments financiers différents négociés en même temps par un même client et contre un seul prix de lot, mais qui n’est pas un “paquet de transactions” au sens de l’article 2, paragraphe 1, point 50), du règlement (UE) n° 600/2014.

“MTCH”	Code signalétique pour les négociations par appariement avec interposition du compte propre	RM, MTF, OTF, APA	Négociation par appariement avec interposition du compte propre au sens de l’article 4, paragraphe 1, point 38), de la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil ⁵ .
“NEGO”	Code signalétique pour les transactions négociées	RM, MTF, OTF, APA	Transactions qui sont négociées à titre privé mais déclarées selon les règles d’une plate-forme de négociation.

»;

⁵ Directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d’instruments financiers et modifiant les directives 2002/92/CE et 2011/61/UE (JO L 173 du 12.6.2014, p. 349, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2014/65/oj>).

(2) l'annexe III est modifiée comme suit:

(a) la section 1 est remplacée par la section suivante:

«1. Instructions pour la présente annexe

1. La référence à l'encours de l'émission d'obligations dans le tableau 2.2 se rapporte à la valeur totale des obligations qui ont été émises et qui sont actuellement détenues par des investisseurs.

2. Par “catégorie d'actifs”, on entend les catégories d'instruments financiers suivantes: obligations, produits financiers structurés, dérivés titrisés, dérivés de taux d'intérêt, dérivés sur actions, dérivés sur matières premières, dérivés de change, dérivés de crédit, dérivés C10, CFD, quotas d'émission et dérivés sur quotas d'émission.

3. Par “montant notionnel quotidien moyen (MNQM)”, on entend le montant notionnel total pour un instrument financier donné, déterminé d'après la mesure de volume indiquée dans le tableau 4 de l'annexe II et exécuté au cours de la période définie à l'article 13, paragraphe 2, divisé par le nombre de jours de négociation compris dans cette période ou, le cas échéant, dans la partie de l'année pendant laquelle cet instrument financier était admis à la négociation ou négocié sur une plate-forme de négociation et sa négociation non suspendue.

4. Par “nombre de transactions quotidien moyen”, on entend le nombre total de transactions portant sur un instrument financier donné exécutées pendant la période définie à l'article 13, divisé par le nombre de jours de négociation compris dans cette période ou, le cas échéant, dans la partie de l'année pendant laquelle cet instrument financier était admis à la négociation ou négocié sur une plate-forme de négociation et sa négociation non suspendue.

5. Par “future” ou “contrat à terme standardisé”, on entend un contrat d'achat ou de vente d'une matière première ou d'un instrument financier à une date ultérieure prédéterminée et à un prix convenu par l'acheteur et le vendeur lors de la conclusion du contrat. Les termes d'un contrat “future” sont standardisés et dictent la qualité et la quantité minimales qui peuvent être achetées ou vendues, le plus petit montant de variation que le prix peut enregistrer, les procédures de livraison, la date d'échéance et d'autres caractéristiques liées au contrat.

6. Par “option”, on entend un contrat conférant à son propriétaire le droit, mais non l'obligation, d'acheter (*call*) ou de vendre (*put*) un instrument financier ou une matière première spécifique à un prix prédéterminé (*strike* ou prix d'exercice), à une date ultérieure donnée ou jusqu'à cette date (date d'exercice).

7. Par “swap” ou “contrat d’échange”, on entend un contrat par lequel deux parties conviennent d’échanger les flux d’un instrument financier contre ceux d’un autre instrument financier à une date ultérieure donnée.

8. Par “swap de portefeuille”, on entend un contrat par lequel les utilisateurs finaux peuvent réaliser des swaps multiples.

9. Par “forward” ou “contrat à terme de gré à gré”, on entend un contrat privé entre deux parties portant sur l’achat ou la vente d’une matière première ou d’un instrument financier à une date ultérieure prédéterminée et à un prix convenu par l’acheteur et le vendeur lors de la conclusion du contrat.

10. Par “swaption” ou “option sur un swap”, on entend un contrat conférant à son propriétaire le droit, mais non l’obligation, de contracter un swap à une date ultérieure donnée ou jusqu’à cette date (date d’exercice).

11. Par “future sur swap” ou “contrat à terme standardisé sur swap”, on entend un contrat à terme standardisé (future) conférant à son propriétaire l’obligation de contracter un swap à une date ultérieure donnée ou jusqu’à cette date.

12. Par “forward sur swap” ou “contrat à terme de gré à gré sur swap”, on entend un contrat à terme de gré à gré (forward) conférant à son propriétaire l’obligation de contracter un swap à une date ultérieure donnée ou d’ici cette date.»;

(b) à la section 2, le tableau 2.2 est remplacé par le tableau suivant:

«Tableau 2.2

Obligations (tous types d’obligations sauf ETC et ETN) — catégories n’ayant pas un marché liquide

Chaque obligation particulière est considérée comme n’ayant pas un marché liquide aux fins de l’article 6 *bis* si elle correspond à l’une des combinaisons spécifiques de caractéristiques d’obligations indiquées dans les différentes lignes des tableaux ci-dessous.

Obligations souveraines et autres obligations publiques

ID groupe	ID MiFIR	Type d’obligation	Émetteur ou pays émetteur	Échéance résiduelle	Type de coupon	Encours de l’émission
	RTS2#3	RTS2#9	Pays de l’émetteur déclaré dans le champ “Identifiant de	Temps restant jusqu’à la date d’échéance déclarée dans le champ “Date	Troisième lettre du code CFI déclaré dans le champ “Classement de	Champ “Montant nominal émis total” du RTS23 converti en EUR

			l'émetteur ou de l'opérateur de la plate-forme de négociation" du règlement délégué (UE) 2017/585 de la Commission ⁶ ("RTS23")	d'échéance" du RTS23	l'instrument" du RTS23	
G1	OBLIGATION	EUSB EUSB désigne une obligation qui n'est ni convertible ni garantie et qui est émise par un émetteur souverain: a) l'Union; b) un État membre, y compris un service administratif, une agence ou une entité ad hoc de cet État membre; c) dans le cas d'un État membre fédéral, une entité fédérée; d) une entité ad hoc pour plusieurs États membres; e) une institution financière internationale établie par au moins deux États membres qui a pour finalité de mobiliser des fonds et d'apporter une aide financière à ceux de ses membres qui connaissent des difficultés financières graves ou risquent d'y être exposés; f) la Banque européenne d'investissement; g) une entité souveraine d'un pays tiers.	Le pays émetteur est un État membre, les États-Unis ou le Royaume-Uni; OU l'émetteur est l'Union; OU l'émetteur est la Banque européenne d'investissement; OU	Jusqu'à 10 ans inclus	F (coupon fixe)	Inférieur à 5 000 000 000 EUR

⁶ 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 (JO L 87 du 31.3.2017, p. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

			l'émetteur est une institution financière internationale établie par au moins deux États membres qui a pour finalité de mobiliser des fonds et d'apporter une aide financière à ceux de ses membres qui connaissent des difficultés financières graves ou risquent d'y être exposés.			
G2	OBLIGATION	EUSB ou OEPB OEPB désigne une obligation qui n'est ni convertible ni garantie et qui est émise par une entité publique qui n'est pas un émetteur souverain.	Tout instrument ne faisant pas partie du G1			Inférieur à 1 000 000 000 EUR

Obligations d'entreprises, obligations convertibles et autres obligations

ID groupe	ID MiFIR	Type d'obligation	Monnaie	Notation de crédit	Encours de l'émission
	RTS2#3	RTS2#9	Monnaie de l'instrument déclarée dans le champ "Monnaie du notionnel 1" du RTS23		Champ "Montant nominal émis total" du RTS23 converti en EUR
G3	OBLIGATION	CRPB, CVTB ou OTHR CRPB désigne une obligation qui n'est ni convertible ni garantie et qui est émise par une Societas Europaea établie conformément au règlement (CE) n° 2157/2001 du Conseil⁷ ou un type de société mentionné à l'annexe I ou à l'annexe II de la directive 2013/34/UE du Parlement européen et du Conseil⁸ ou un type équivalent dans un pays tiers CVTB désigne un instrument consistant en une obligation ou un instrument de dette titrisée avec un dérivé incorporé tel qu'une option d'achat sur l'action sous-jacente	EUR, GBP, USD	Catégorie investissement (<i>investment grade</i>)	Inférieur à 500 000 000 EUR
G4	OBLIGATION	CRPB, CVTB ou OTHR	Tout instrument ne faisant pas partie du G3		Inférieur à 500 000 000 EUR

⁷ Règlement (CE) n° 2157/2001 du Conseil du 8 octobre 2001 relatif au statut de la société européenne (SE) (JO L 294 du 10.11.2001, p. 1, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/OJ>).

⁸ Directive 2013/34/UE du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 relative aux états financiers annuels, aux états financiers consolidés et aux rapports y afférents de certaines formes d'entreprises, modifiant la directive 2006/43/CE du Parlement européen et du Conseil et abrogeant les directives 78/660/CEE et 83/349/CEE du Conseil (JO L 182 du 29.6.2013, p. 19. ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj>).

Obligations garanties

ID groupe	ID MiFIR	Type d'obligation	Encours de l'émission
	RTS2#3	RTS2#9	Champ "Montant nominal émis total" du RTS23 converti en EUR
G5	OBLIGATION	CVDB CVDB désigne des obligations telles que visées à l'article 52, paragraphe 4, de la directive 2009/65/CE	Inférieur à 500 000 000 EUR

»;

(c) les sections 4 à 11 sont remplacées par le texte suivant:

«4. Produits dérivés cotés

Tableau 4.1

Dérivés sur actions – détermination de la liquidité, fourchettes de MNQM, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

ID catégorie	Catégorie	Aux fins de la détermination du seuil de taille élevée prénégociation et du seuil de taille de transaction, chaque catégorie est segmentée plus avant en sous-catégories, telles que	Détermination de la liquidité	Fourchettes de montants notionnels quotidiens moyens (MNQM)	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
						Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation

		définies ci-dessous.						
EQ1	Options sur indice d'actions	Les subdivisions des options sur indice d'actions sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice d'actions sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 200 millions d'EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 millions d'EUR ≤ MNQM < 600 millions d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				MNQM ≥ 600 millions d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
EQ2	Futures sur indice d'actions	Les subdivisions des futures/forwards sur indice d'actions sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice d'actions sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 1 milliard d'EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 milliard d'EUR ≤ MNQM < 3 milliards d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				3 milliards d'EUR ≤ MNQM < 5 milliards d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
				MNQM ≥ 5 milliards d'EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ3	Options sur actions	Les subdivisions des options sur actions (<i>stock</i>	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR

		options) sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – action sous-jacente		5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ4	Futures sur actions	Les subdivisions des futures/forwards sur actions sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – action sous-jacente	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ5	Options sur dividende	Les subdivisions des options sur dividende sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 — action sous-jacente donnant droit au dividende	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR	900 000 EUR
				5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	1 100 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR

EQ6	Futures sur dividende	Les subdivisions des futures/forwards sur dividende sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – action sous-jacente donnant droit au dividende	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR	900 000 EUR
				5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	1 100 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
EQ7	Options sur indice de dividendes	Les subdivisions des options sur indice de dividendes sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice de dividendes sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 200 millions d'EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 millions d'EUR ≤ MNQM < 600 millions d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				MNQM ≥ 600 millions d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
EQ8	Futures sur indice de dividendes	Les subdivisions des futures/forwards sur indice de dividendes sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice de dividendes sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 1 milliard d'EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 milliard d'EUR ≤ MNQM < 3 milliards d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR

				3 milliards d'EUR ≤ MNQM < 5 milliards d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
				MNQM ≥ 5 milliards d'EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ9	Options sur indice de volatilité	Les subdivisions des options sur indice de volatilité sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice de volatilité sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 200 millions d'EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 millions d'EUR ≤ MNQM < 600 millions d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				MNQM ≥ 600 millions d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
EQ10	Futures sur indice de volatilité	Les subdivisions des futures/forwards sur indice de volatilité sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – indice de volatilité sous-jacent	Liquide	MNQM < 100 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 millions d'EUR ≤ MNQM < 1 milliard d'EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 milliard d'EUR ≤ MNQM < 3 milliards d'EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				3 milliards d'EUR ≤ MNQM < 5 milliards d'EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
				MNQM ≥ 5 milliards d'EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ11	Options sur fonds cotés (ETF)	Les subdivisions des options sur fonds cotés	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR

		(ETF) sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – ETF sous-jacent		5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ12	Futures sur fonds cotés (ETF)	Les subdivisions des futures/forwards sur fonds cotés (ETF) sont définies par le critère de subdivision suivant: Critère de subdivision 1 – ETF sous-jacent	Liquide	MNQM < 5 millions d'EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 millions d'EUR ≤ MNQM < 10 millions d'EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 millions d'EUR ≤ MNQM < 20 millions d'EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				MNQM ≥ 20 millions d'EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ13	Contrats d'échange (swaps)		Non liquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
EQ14	Swaps de portefeuille		Non liquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
EQ15	Autres dérivés sur actions		Non liquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
Durée du report de publication						Fin de journée (End-of-day)	T + 1	T + 2

Tableau 4.2

Dérivés de taux d'intérêt – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
				Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation
IR01	Futures sur Bobl	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
IR02	Futures sur Bund	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR03	Futures sur Buxl	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR04	Futures sur Schatz	Liquide	1 000 000 EUR	2 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR
IR05	Futures Euro OAT	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR06	Futures Euro BTP à long terme	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR07	Futures Euro BTP à court terme	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
IR08	Futures Euro STR à trois mois	Liquide	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR	12 500 000 EUR	25 000 000 EUR
IR09	Options sur futures sur Bobl	Liquide	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR	3 750 000 EUR	5 000 000 EUR
IR10	Options sur futures sur Bund	Liquide	2 750 000 EUR	5 500 000 EUR	8 250 000 EUR	11 000 000 EUR
IR11	Autres dérivés de taux d'intérêt	Non liquide	50 000 EUR	100 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR
Durée du report de publication				Fin de journée (End-of-day)	T + 1	T + 2

Tableau 4.3

Dérivés sur matières premières ou sur quotas d'émission – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
				Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation
AG01	Futures sur le blé meunier	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
AG02	Futures sur le colza	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
AG03	Futures sur le maïs	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
EA01	Futures sur les quotas d'émission de l'Union européenne	Liquide	50 000 tonnes équivalent dioxyde de carbone	100 000 tonnes équivalent dioxyde de carbone	150 000 tonnes équivalent dioxyde de carbone	200 000 tonnes équivalent dioxyde de carbone
EL01	Futures sur l'électricité allemande (charge de base, mensuels)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
EL02	Futures sur l'électricité française (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL03	Futures sur l'électricité italienne (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL04	Futures sur l'électricité nordique (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL05	Futures sur l'électricité espagnole (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR

EL06	Futures sur l'électricité néerlandaise (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL07	Futures sur l'électricité hongroise (charge de base, mensuels)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
NG01	Futures Dutch TTF gas (mensuels)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
NG02	Futures German THE gas (mensuels)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
NG03	Options sur futures Dutch TTF gas (mensuelles)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
Durée du report de publication				Fin de journée (End-of-day)	T + 1	T + 2

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille moyenne/élevée/très élevée post-négociation (supérieure ou égale à)
	Autres dérivés sur matières premières ou sur quotas d'émission	Non liquide	100 000 EUR	200 000 EUR
Durée du report de publication				T + 2

Tableau 4.4**Dérivés de crédit – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication**

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille moyenne/élevée/très élevée post-négociation (supérieure ou égale à)
CR01	Dérivés de crédit	Non liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Durée du report de publication				T + 2

Tableau 4.5**Dérivés de change – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication**

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille moyenne/élevée/très élevée post-négociation (supérieure ou égale à)
FX01	Dérivés de change	Non liquide	12 500 000 EUR	25 000 000 EUR
Durée du report de publication				T + 2

Tableau 4.6**Dérivés titrisés – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication**

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
				Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation

SD01	Dérivés titrisés	Liquide	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Durée du report de publication				Fin de journée (End-of-day)	T + 1	T + 2

Tableau 4.7

Dérivés titrisés – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

ID catégorie	Catégorie	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille moyenne/élevée/très élevée post-négociation (supérieure ou égale à)
OT01	Autres dérivés	Non liquide	50 000 EUR	100 000 EUR
Durée du report de publication				T + 2

5. Dérivés de gré à gré visés à l'article 8 *bis*, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 600/2014

Tableau 5.1

Contrats d'échange sur risque de crédit (CDS) qui relèvent de l'article 8 *bis*, paragraphe 2, point a), du règlement (UE) n° 600/2014 – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

Contrats d'échange sur risque de crédit (CDS) relevant de l'article 8 <i>bis</i> , paragraphe 2, point a), du règlement (UE) n° 600/2014	Caractéristique	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
				Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation

iTraxx Europe Main	Émission à cinq ans la plus récente (<i>5Y on-the-run</i>) et première émission précédente (<i>first off-the-run</i>)	Liquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR	500 000 000 EUR
iTraxx Europe Crossover		Liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume				15 minutes	Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix				15 minutes	15 minutes	15 minutes
Tout autre CDS qui relève du champ d'application de l'article 8 <i>bis</i> , paragraphe 2, point a), du règlement (UE) n° 600/2014	N'importe	Non liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume				Une semaine	Deux semaines	Trois mois
Durée du report de publication du prix				Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Tableau 5.2

Dérivés de taux d'intérêt visés à l'article 8 *bis*, paragraphe 2, point a), du règlement (UE) n° 600/2014 – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

Catégorie – EURIBOR fixe contre variable				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation

1	Liquide	200 000 000 EUR	400 000 000 EUR	750 000 000 EUR
2	Liquide	125 000 000 EUR	250 000 000 EUR	400 000 000 EUR
3	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	400 000 000 EUR
5	Liquide	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR
7	Liquide	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR
10	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
12	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
15	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
20	Liquide	25 000 000 EUR	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR
25	Liquide	25 000 000 EUR	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR
30	Liquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume			Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Catégorie – OIS FedFunds				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation
1	Non liquide	125 000 000 USD	250 000 000 USD	400 000 000 USD
2	Non liquide	75 000 000 USD	150 000 000 USD	250 000 000 USD
3	Non liquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	200 000 000 USD
Durée du report de publication du volume			T + 1	Trois mois
Durée du report de publication du prix			T + 1	T + 1

Catégorie – OIS SOFR				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation
1	Liquide	125 000 000 USD	250 000 000 USD	500 000 000 USD
2	Liquide	75 000 000 USD	150 000 000 USD	250 000 000 USD
3	Liquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	200 000 000 USD
5	Liquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	150 000 000 USD
7	Liquide	37 500 000 USD	75 000 000 USD	150 000 000 USD
10	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
12	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
15	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
20	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
25	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
30	Liquide	15 000 000 USD	30 000 000 USD	50 000 000 USD
Durée du report de publication du volume			Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Catégorie – OIS SONIA				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	

			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation
1	Liquide	87 500 000 GBP	175 000 000 GBP	355 000 000 GBP
2	Liquide	67 500 000 GBP	135 000 000 GBP	175 000 000 GBP
3	Liquide	67 500 000 GBP	135 000 000 GBP	175 000 000 GBP
5	Liquide	32 500 000 GBP	65 000 000 GBP	90 000 000 GBP
7	Liquide	32 500 000 GBP	65 000 000 GBP	90 000 000 GBP
10	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
12	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
15	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
20	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
25	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
30	Liquide	10 000 000 GBP	20 000 000 GBP	25 000 000 GBP
Durée du report de publication du volume			Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Catégorie – OIS TONA				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation
1	Liquide	17 500 000 000 JPY	35 000 000 000 JPY	55 000 000 000 JPY
2	Liquide	10 000 000 000 JPY	20 000 000 000 JPY	30 000 000 000 JPY

3	Liquide	10 000 000 000 JPY	20 000 000 000 JPY	30 000 000 000 JPY
5	Liquide	5 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY	15 000 000 000 JPY
7	Liquide	5 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY	15 000 000 000 JPY
10	Liquide	3 500 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY
12	Liquide	3 500 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY
15	Liquide	2 500 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY
20	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
25	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
30	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
Durée du report de publication du volume			Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Catégorie – OIS EuroSTR				
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)	
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée/très élevée post-négociation
1	Liquide	150 000 000 EUR	300 000 000 EUR	750 000 000 EUR
2	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	300 000 000 EUR
3	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	300 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume			Fin de journée (End-of-day)	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

Tableau 5.3

Contrats d'échange sur risque de crédit (CDS) reposant sur une seule signature visés à l'article 8 *bis*, paragraphe 2, point b), du règlement (UE) n° 600/2014 – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

Catégorie – Contrats d'échange sur risque de crédit reposant sur une seule signature visés à l'article 8 <i>bis</i>, paragraphe 2, point b), du règlement (UE) n° 600/2014					
Durée de vie (années)	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
			Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation
5	Non liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume			T + 1	Deux semaines	Trois mois
Durée du report de publication du prix			T + 1	T + 1	T + 1
Toute autre durée de vie	Non liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume			Une semaine	Deux semaines	Trois mois
Durée du report de publication du prix			Une semaine	Une semaine	Une semaine

Tableau 5.4

Contrats d'échange sur risque de crédit (CDS) visés à l'article 8 *bis*, paragraphe 2, point c), du règlement (UE) n° 600/2014 – détermination de la liquidité, seuil de taille élevée prénégociation et régime de report de la publication

Contrats d'échange sur risque de crédit (CDS) se référant à un indice comprenant des banques d'importance systémique mondiale	Caractéristique	Détermination de la liquidité	Seuil de taille élevée prénégociation	Seuil de taille de transaction (supérieure ou égale à)		
				Seuil de taille moyenne post-négociation	Seuil de taille élevée post-négociation	Seuil de taille très élevée post-négociation
iTraxx Europe Senior Financials	Émission à cinq ans la plus récente et première émission précédente	Non liquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR	300 000 000 EUR
iTraxx Europe Subordinate Financial		Non liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume				Une semaine	Deux semaines	Trois mois
Durée du report de publication du prix				15 minutes	15 minutes	Fin de journée (End-of-day)
Tout autre CDS se référant à un indice visé à l'article 8 <i>bis</i> , paragraphe 2, point c), du règlement (UE) n° 600/2014	N'importe	Non liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Durée du report de publication du volume				Une semaine	Deux semaines	Trois mois
Durée du report de publication du prix				Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)	Fin de journée (End-of-day)

»;

(d) la section 13 est supprimée.

ANNEXE II

L'annexe II du règlement délégué (UE) 2025/1155 est modifiée comme suit:

(1) le titre est remplacé par le texte suivant:

«Données réglementaires et données de marché essentielles post-négociation à transmettre au CTP pour les obligations, au CTP pour les actions et les fonds cotés et au CTP pour les dérivés de gré à gré et à diffuser par ceux-ci conformément aux articles 5, 6, 6 bis, 7, 8 et 8 bis»;

(2) dans le tableau 1, le titre est remplacé par le texte suivant:

«Symboles utilisés dans les tableaux 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9 et 10»;

(3) les tableaux 8, 9 et 10 suivants sont ajoutés:

«Tableau 8

Données réglementaires pour les dérivés de gré à gré, par instrument

#	Intitulé du champ	Description	Format Des formats équivalents peuvent être utilisés, en fonction de la syntaxe utilisée pour la transmission des données.	Champ de données d'entrée/de sortie
1	Code d'identification de l'instrument	Le code utilisé pour identifier l'instrument financier.	L'identification de l'instrument financier s'effectue conformément au règlement délégué (UE) 2025/1003 de la Commission.	Les deux
2	Date et heure de début du statut de l'instrument	La date et l'heure à partir desquelles le statut de l'instrument est valide. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 12.	{DATE_TIME_FORMAT}	Les deux
3	Monnaie	L'unité monétaire majeure dans laquelle l'instrument est négocié.	{CURRENCYCODE_3}	Les deux
4	Date et heure de diffusion	La date et l'heure auxquelles le statut de l'instrument est diffusé par le CTP. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 15.	{DATE_TIME_FORMAT}	Sortie
5	Statut de l'instrument	Description du statut de l'instrument financier. Le statut de l'instrument financier correspond à l'un des éléments suivants: 1) suspension de la négociation, sur la plate-forme	“SUSP”: suspension de l'instrument “REMOV”: retrait	Les deux

#	Intitulé du champ	Description	Format Des formats équivalents peuvent être utilisés, en fonction de la syntaxe utilisée pour la transmission des données.	Champ de données d'entrée/de sortie
		de négociation identifiée dans le champ "Plate-forme de négociation", conformément à l'article 32 de la directive 2014/65/UE; 2) retrait de la négociation, sur la plate-forme de négociation identifiée dans le champ "Plate-forme de négociation", conformément à l'article 32 de la directive 2014/65/UE; 3) interruption de la négociation, sur la plate-forme de négociation identifiée dans le champ "Plate-forme de négociation", conformément à l'article 18, paragraphe 5, de la directive 2014/65/UE; 4) disponible pour la négociation après une suspension, un retrait ou une interruption.	de l'instrument "HALT": interruption de la négociation de l'instrument "ACTV": l'instrument est disponible pour la négociation après une suspension, un retrait ou une interruption	
6	Plate-forme de négociation	Identification de la plate-forme de négociation sur laquelle le statut de l'instrument est valide (MIC de segment si possible, autrement MIC d'exploitation). La plate-forme de négociation est un MTF ou un OTF.	{MIC}	Les deux
7	Système de négociation	Le type de système de négociation sur lequel l'instrument est négocié.	"CLOB": carnet central d'ordres à cours limité "QDTS": marché dirigé par les prix "PATS": enchères périodiques "RFQT": demande d'offres de prix (request for quotes) "VOIC": système de négociation à la crie "HYBR": système hybride "OTHR": autre	Les deux

Tableau 9
Données réglementaires pour les dérivés de gré à gré, par système d'appariement des ordres

#	Intitulé du champ	Description	Format Des formats équivalents peuvent être utilisés, en fonction de la syntaxe utilisée pour la transmission des données.	Champ de données d'entrée/de sortie
1	Plate-forme de négociation	Identification de la plate-forme de négociation sur laquelle le statut du système d'appariement des ordres est valide (MIC de segment si possible, autrement MIC d'exploitation). La plate-forme de négociation est un MTF ou un OTF.	{MIC}	Les deux
2	Système de négociation	Le type de système de négociation sur lequel le statut du système est fourni.	“CLOB”: carnet central d'ordres à cours limité “QDTS”: marché dirigé par les prix “PATS”: enchères périodiques “RFQT”: demande d'offres de prix (<i>request for quotes</i>) “VOIC”: système de négociation à la criée “HYBR”: système hybride “OTHR”: Autre	Les deux
3	Date et heure de début du statut du système	La date et l'heure à partir desquelles le statut du système est valide. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 12.	{DATE_TIME_FORMAT}	Les deux
4	Date et heure de diffusion	La date et l'heure auxquelles le statut du système est diffusé par le CTP. Le niveau de granularité est conforme aux exigences	{DATE_TIME_FORMAT}	Sortie

		énoncées à l'article 15.		
5	Statut du système de négociation	Le statut du système de négociation sur lequel l'instrument est négocié.	“ACTV”: système actif “OTAG”: panne du système de négociation “POTG”: panne partielle du système de négociation	Les deux

Tableau 10
Données de marché essentielles post-négociation pour les dérivés de gré à gré

#	Intitulé du champ	Description et informations à publier	Type de lieu d'exécution ou de publication	Format à employer, tel que défini dans le tableau 1	Champ de données d'entrée /de sortie
1	Date et heure de la transaction	Tableau 2, champ 1, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.		Des formats équivalents peuvent être utilisés, en fonction de la syntaxe utilisée pour la transmission des données.	Les deux
2	Code d'identification de l'instrument	Tableau 2, champ 2, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
3	Date de prise d'effet	Tableau 2, champ 2a, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
4	Date d'expiration	Tableau 2, champ 2b, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
5	Prix	Tableau 2, champ 3, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
6	Prix manquant	Tableau 2, champ 4, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
7	Monnaie du prix	Tableau 2, champ 5, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
8	Expression du prix	Tableau 2, champ 6, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
9	Quantité	Tableau 2, champ 7, de l'annexe II du			Les deux

		règlement délégué (UE) 2017/583.			
10	Montant notionnel	Tableau 2, champ 10, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
11	Monnaie du notionnel	Tableau 2, champ 11, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
12	Lieu d'exécution	Tableau 2, champ 13, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
13	Plate-forme de négociation de pays tiers utilisée pour l'exécution	Tableau 2, champ 14, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
14	Date et heure auxquelles le contributeur en données a reçu les données	La date et l'heure auxquelles la déclaration de transaction a été reçue par un APA. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 15.	APA	{DATE_TIME_FORMAT}	Entrée
15	Date et heure auxquelles le contributeur en données a publié la transaction	Tableau 2, champ 15, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
16	Lieu de publication	Tableau 2, champ 16, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
17	Code d'identification de la transaction	Tableau 2, champ 17, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
18	Date et heure de réception par le CTP	La date et l'heure auxquelles la transaction a été reçue par le CTP. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 15.	CTP	{DATE_TIME_FORMAT}	Sortie
19	Date et heure de publication par le CTP	La date et l'heure auxquelles la transaction a été publiée par le CTP. Le niveau de granularité est conforme aux exigences énoncées à l'article 15.	CTP	{DATE_TIME_FORMAT}	Sortie
20	Codes signalétiques	Tableau 2, champ 19, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
21	Code signalétique de donnée suspecte	Un code signalétique relatif à la qualité des données, à remplir par le CTP lorsque l'APA ou le CTP ont identifié des transactions qui, selon eux, pourraient faire l'objet de problèmes de qualité des données.	CTP	TRUE ou FALSE	Sortie

22	Type de système de négociation	Tableau 2, champ 20, de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.			Les deux
----	--------------------------------	---	--	--	----------

».

(4)

ANNEXE III

À l'annexe IV du règlement délégué (UE) 2025/1155, le tableau 2 est remplacé par le tableau suivant:

«Tableau 2

Niveau de précision pour les membres, participants ou utilisateurs d'une plateforme de négociation

Type d'activité de négociation	Description	Écart maximal par rapport au TUC	Granularité de l'horodatage
Activité utilisant une technique de trading algorithmique à haute fréquence	Technique de trading algorithmique à haute fréquence.	100 microsecondes	0,1 microseconde ou mieux
Activité sur des systèmes de négociation à la crie	Systèmes de négociation à la crie tels que définis dans le tableau 2 de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.	1 seconde	1 seconde ou mieux
Activité sur des systèmes de demandes d'offres de prix (<i>request for quotes</i>) qui nécessitent, pour les transactions, une intervention humaine ou qui ne permettent pas le trading algorithmique	Systèmes de demandes d'offres de prix (<i>request for quotes</i>) tels que définis dans le tableau 2 de l'annexe II du règlement délégué (UE) 2017/583.	1 seconde	1 seconde ou mieux
Activité de conclusion de transactions négociées	Transaction négociée telle que définie à l'article 4, paragraphe 1, point b), du règlement (UE) n° 600/2014.	1 seconde	1 seconde ou mieux
Toute autre activité de négociation	Toutes les autres activités de négociation non couvertes par le présent tableau.	1 milliseconde	1 milliseconde ou mieux

».