



Bruxelles, le 8.6.2016
C(2016) 3333 final

ANNEX 1

ANNEXE

au

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

complétant la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil concernant les marchés d'instruments financiers par des normes techniques de réglementation relatives aux données que doivent publier les plates-formes d'exécution sur la qualité d'exécution des transactions

ANNEXE

**Tableau 1 - Informations d'identification à publier conformément à l'article 3,
paragraphe 1 – Type de plate-forme d'exécution**

Plate-forme	Nom	Identifiant (code d'identification de marché MIC selon la norme ISO 10383 ou code d'entité juridique LEI)	
Pays de l'autorité compétente	Nom		
Segment de marché	Nom	Identifiant (MIC du segment de marché selon ISO 10383)	
Date de la séance de négociation	ISO 8601		
Défaillances	Nature	Nombre	Durée moyenne
Enchères programmées	Nature	Nombre	Durée moyenne
Transactions avortées		Nombre	Valeur (en % de la valeur totale des transactions exécutées à la date indiquée)

**Tableau 2 - Informations d'identification à publier conformément à l'article 3,
paragraphe 2 – Type d'instrument financier**

Instrument financier	Nom	Identifiant (ISO 6166)
Description écrite de l'instrument financier en cas d'absence d'identifiant (monnaie de l'instrument sous-jacent, multiplicateur du prix, expression du prix, expression de la quantité et type de livraison)		
Catégorie d'instrument financier	(code CFI selon la norme ISO 10962)	
Monnaie	(ISO 4217)	

Tableau 3 - Informations sur les prix à publier conformément à l'article 4, point a)

Heure (instant T)	Intervalles de taille	Ensemble des transactions exécutées dans les deux premières minutes suivant l'instant T		Première transaction effectuée après l'instant T (s'il n'y en a pas eu dans les deux premières minutes suivant l'instant T)						
		Prix moyen simple des transactions exécutées (à l'exclusion des commissions et intérêts courus)	Montant total des transactions exécutées	Prix	Heure d'exécution	Taille des transactions	Système de négociation	Mode de négociation	Plateforme de négociation	Meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente (<i>best bid and offer</i>) ou prix de référence approprié au moment de l'exécution
09:30:00	1									
	2									
	3									
11:30:00	1									
	2									
	3									
13:30:00	1									
	2									

	3									
15:30:00	1									
	2									
	3									

Tableau 4 - Informations sur les prix à publier conformément à l'article 4, point b)

Prix moyen simple des transactions	
Prix moyen des transactions pondéré en fonction du volume	
Prix d'exécution le plus élevé	
Prix d'exécution le plus bas	

Tableau 5 - Informations sur les coûts à publier conformément à l'article 5

Informations requises par l'article 5, points a) à d)	(Description)
Lien vers un site web ou une autre source d'information supplémentaire sur les coûts	
Montant total des remises, ristournes et autres types de paiements proposés (en % de la valeur totale des transactions effectuées sur la période de déclaration)	%
Montant total des coûts (en % de la valeur totale des transactions effectuées sur la période de déclaration)	%

Tableau 6 - Informations sur la probabilité d'exécution à publier conformément à l'article 6

Nombre d'ordres ou de demandes d'offres de prix reçus	
Nombre de transactions exécutées	
Valeur totale des transactions exécutées	
Nombre d'ordres ou de demandes d'offres de prix reçus qui ont été annulés ou retirés	
Nombre d'ordres ou de demandes d'offres de prix reçus qui ont été modifiés	
Taille médiane des transactions	
Taille médiane de l'ensemble des ordres ou demandes d'offres de prix	
Nombre de teneurs de marché désignés	

Tableau 7 - Informations sur la probabilité d'exécution à publier conformément à l'article 7, paragraphe 1

Heure	Meilleur prix affiché à l'achat	Meilleur prix affiché à la vente	Taille de la meilleure offre d'achat	Taille de la meilleure offre de vente	Profondeur du carnet d'ordres pour trois paliers de prix
09:30:00					

11:30:00					
13:30:00					
15:30:00					

Tableau 8 - Informations à publier conformément à l'article 7, paragraphes 2 et 3

Écart effectif moyen	
Volume moyen aux meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente	
Écart moyen entre les meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente	
Nombre d'annulations aux meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente	
Nombre de modifications aux meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente	
Profondeur moyenne du carnet d'ordres pour trois paliers de prix	
Temps moyen et temps médian écoulés entre la réception, par la plate-forme d'exécution, d'un ordre agressif ou d'une acceptation d'offre de prix et l'exécution totale ou partielle	
Temps médian (à la milliseconde) écoulé entre la réception, par la plate-forme d'exécution, d'un ordre au marché et son exécution totale ou partielle	
Vitesse moyenne d'exécution des ordres passifs non modifiés aux meilleurs prix affichés à l'achat et à la vente	
Nombre d'ordres <i>Fill or Kill</i> avortés	
Nombre d'ordres <i>Immediate or Cancel</i> dont aucune portion n'a été exécutée	
Nombre de transactions exécutées sur la plate-forme de négociation qui sont d'une taille élevée au sens de l'article 4 ou 9 du règlement (UE) n° 600/2014	
Valeur des transactions exécutées sur la plate-forme de négociation qui sont d'une taille élevée au sens de l'article 4 ou 9 du règlement (UE) n° 600/2014	
Nombre de transactions exécutées sur la plate-forme de négociation qui ne sont pas d'une taille élevée au sens de l'article 4 ou de l'article 9 du règlement MiFIR, à l'exclusion des ordres placés dans un système de gestion des ordres de la plate-forme de négociation en attendant leur divulgation	
Valeur des transactions exécutées sur la plate-forme de négociation qui ne sont pas d'une taille élevée au sens de l'article 4 ou de l'article 9 du règlement MiFIR, à l'exclusion des ordres placés dans un système de gestion des ordres de la plate-forme de négociation en	

attendant leur divulgation	
Nombre d'interruptions de la négociation	
Durée moyenne des interruptions de la négociation	
Nombre de suspensions	
Nature des suspensions	
Durée moyenne des suspensions	
Pour les plates-formes utilisant un système de négociation en continu dirigé par les prix, nombre de périodes durant lesquelles aucune offre n'a été faite	
Pour les plates-formes utilisant un système de négociation en continu dirigé par les prix, durée moyenne des périodes durant lesquelles aucune offre n'a été faite	
Taux moyen de présence des offres	

Tableau 9 - Informations à publier conformément à l'article 8

Temps moyen écoulé entre l'acceptation et l'exécution	
Temps médian écoulé entre l'acceptation et l'exécution	
Temps moyen écoulé entre la demande et la fourniture d'offres de prix	
Temps médian écoulé entre la demande et la fourniture d'offres de prix	