



Bruxelles, le 8.6.2016
C(2016) 3337 final

ANNEXES 1 to 2

ANNEXES

du

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ DE LA COMMISSION

complétant la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant la publication annuelle par les entreprises d'investissement d'informations sur l'identité des plates-formes d'exécution et la qualité de l'exécution

ANNEXES

Annexe I: Catégories d'instruments financiers

- (a) Actions et instruments assimilés— actions & certificats représentatifs
 - (i) Niveaux pas de cotation/liquidité 5 et 6 (plus de 2000 transactions par jour)
 - (ii) Niveaux pas de cotation/liquidité 3 et 4 (de 80 à 1999 transactions par jour)
 - (iii) Niveaux pas de cotation/liquidité 1 et 2 (de 0 à 79 transactions par jour)
- (b) Instruments de dette
 - (i) Obligations
 - (ii) Instruments du marché monétaire
- (c) Dérivés sur taux d'intérêt
 - (i) Futures et options admis à la négociation sur une plate-forme de négociation
 - (ii) Swaps, forwards et autres dérivés sur taux d'intérêt
- (d) Dérivés de crédit
 - (i) Futures et options admis à la négociation sur une plate-forme de négociation
 - (ii) Autres dérivés de crédit
- (e) Dérivés sur devises
 - (i) Futures et options admis à la négociation sur une plate-forme de négociation
 - (ii) Swaps, forwards et autres dérivés sur devises
- (f) Instruments financiers structurés
- (g) Dérivés sur actions
 - (i) Options et futures admis à la négociation sur une plate-forme de négociation
 - (ii) Swaps et autres dérivés sur actions

- (h) Dérivés titrisés
 - (i) Warrants et dérivés sur certificats préférentiels
 - (ii) Autres dérivés titrisés
- (i) Dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission
 - (i) Options et futures admis à la négociation sur une plate-forme de négociation
 - (ii) Autres dérivés sur matières premières et sur quotas d'émission
- (j) Contrats financiers avec paiement d'un différentiel
- (k) Produits indiciaires cotés (ETP) [fonds indiciaires cotés (ETF), exchange traded notes (ETN) et exchange traded commodities (ETC)]
- (l) Quotas d'émission
- (m) Autres instruments

Annexe II

Tableau 1

Catégorie d'instruments					
Indiquer si <1 ordre exécuté en moyenne par jour ouvrable de l'année précédente	O / N				
Cinq premières plateformes d'exécution classées par volumes de négociation (ordre décroissant)	Proportion du volume d'ordres exécutés en pourcentage du volume total dans cette catégorie	Proportion du nombre d'ordres exécutés en pourcentage du nombre total dans cette catégorie	Pourcentage d'ordres passifs	Pourcentage d'ordres agressifs	Pourcentage d'ordres dirigés
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					

Tableau 2

Catégorie d'instruments					
Indiquer si <1 ordre exécuté en moyenne par jour ouvrable de l'année précédente	O / N				
Cinq premières plateformes d'exécution classées par volumes de négociation (ordre décroissant)	Proportion du volume d'ordres exécutés en pourcentage du volume total dans cette catégorie	Proportion du nombre d'ordres exécutés en pourcentage du nombre total dans cette catégorie	Pourcentage d'ordres passifs	Pourcentage d'ordres agressifs	Pourcentage d'ordres dirigés
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)					

Tableau 3

Catégorie d'instruments		
Indiquer si <1 ordre exécuté en moyenne par jour ouvrable de l'année précédente	Oui / Non	
Cinq premières plateformes classées par volumes de négociation (ordre décroissant)	Proportion du volume d'ordres exécutés en pourcentage du volume total dans cette catégorie	Proportion du nombre d'ordres exécutés en pourcentage du nombre total dans cette catégorie
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)		
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)		
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)		
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)		
Nom et code d'identification de la plateforme (MIC ou LEI)		