

Instruction AMF n°2007-07

Déclaration à l'AMF par les entreprises de marché et prestataires gestionnaires d'un système multilatéral de négociation des ordres et transactions sur instruments financiers

Textes de référence : Articles 514-9, 523-6, 523-7 et 524-1 du règlement général de l'AMF

Plan de l'instruction :

Article 1.	Informations à déclarer par une entreprise de marché, un gestionnaire d'un système multilatéral de négociation ou un gestionnaire d'un système multilatéral de négociation organisé concernant les ordres reçus de ses membres.....	1
Article 2.	Informations à déclarer par une entreprise de marché concernant les transactions effectuées dans les systèmes du marché réglementé.....	2
Article 3.	Informations à déclarer par le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation ou le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation organisé concernant les transactions effectuées dans ledit système.....	2
Article 4.	Modalité de transmission des déclarations.....	3
Article 5.	Délais de déclaration.....	3
Article 6.	Corrections et annulations.....	3

Article 1. Informations à déclarer par une entreprise de marché, un gestionnaire d'un système multilatéral de négociation ou un gestionnaire d'un système multilatéral de négociation organisé concernant les ordres reçus de ses membres

I. - Une entreprise de marché mentionnée à l'article L. 421-2 du code monétaire et financier et un gestionnaire de système multilatéral de négociation mentionné à l'article L 424-1 du même code transmettent à l'AMF les informations suivantes sur les ordres reçus de leurs membres sur des instruments financiers mentionnés à l'article L. 211-1 du code monétaire et financier admis aux négociations sur un marché réglementé d'un État partie à l'accord sur l'Espace économique européen :

1° L'identifiant du membre ayant transmis l'ordre ;

2° L'identifiant de l'instrument financier concerné . Le code ISIN sera utilisé ou, si ce code n'existe pas, un identifiant accepté par l'AMF ;

3° La date et l'heure de la présentation de l'ordre sur le marché réglementé ou le système multilatéral de négociation ;

4° Les caractéristiques de l'ordre, incluant notamment le nombre d'instruments financiers concernés, le sens, les conditions de prix, le type de l'ordre, son état et sa période de validité ;

5° L'identifiant de l'ordre ;

6° La nature pour compte propre ou pour compte de tiers de l'ordre produit par le membre sur le marché réglementé. Lorsque les règles d'un système multilatéral de négociation prévoient la distinction pour compte propre ou pour compte de tiers des ordres produits par ses membres, cette information est exigée dans le compte rendu que le gestionnaire de ce système multilatéral de négociation adresse à l'AMF.

II. - Le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation organisé mentionné à l'article 524-1 du règlement général de l'AMF, transmet à l'AMF les informations mentionnées au I sur les ordres reçus de ses membres sur des instruments financiers mentionnés à l'article L. 211-1 du code monétaire et financier.

Article 2. Informations à déclarer par une entreprise de marché concernant les transactions effectuées dans les systèmes du marché réglementé

L'information transmise à l'AMF par l'entreprise de marché mentionnée à l'article L. 421-2 du code monétaire et financier sur les transactions effectuées par ses membres dans ses systèmes précise :

1° L'identifiant du membre acheteur ou vendeur ;

2° L'identifiant de l'instrument financier concerné . Le code ISIN sera utilisé ou, si ce code n'existe pas, un identifiant accepté par l'AMF ;

3° La date et l'heure d'exécution de la transaction ;

4° Le nombre d'instruments financiers concernés ;

5° Le sens (achat ou vente) de la transaction ;

6° Le prix unitaire de la transaction ;

7° Le montant total de la transaction (incluant, le cas échéant, le coupon couru) ;

8° La nature pour compte propre ou pour compte de tiers de la transaction ;

9° La date de dénouement théorique lorsqu'elle diffère de celle fixée par défaut dans les règles du marché ; elle n'est pas requise pour les instruments financiers à terme ;

10° L'identifiant du membre contrepartie de la transaction sauf lorsque les règles prévoient l'anonymat des transactions ;

11° L'identifiant unique de la transaction ;

12° L'indicateur d'annulation ;

13° L'identifiant des ordres d'achat ou de vente qui ont donné lieu à la transaction.

Article 3. Informations à déclarer par le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation ou le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation organisé concernant les transactions effectuées dans ledit système

Le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation mentionné à l'article L 424-1 du code monétaire et financier rend compte à l'AMF des transactions effectuées par ses membres dans ce système sur tout instrument financier qui y est négocié. L'information transmise par le gestionnaire est définie à l'article 2.

Dès lors que les règles du système multilatéral de négociation ne prévoient pas la distinction entre les opérations pour compte propre ou pour compte de tiers conclues par ses membres, le gestionnaire est dispensé de fournir l'information mentionnée au point 8 de l'article 2.

Le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation transmet à l'AMF l'information mentionnée au 13° de l'article 2 uniquement si les transactions portent sur un instrument financier admis aux négociations sur un marché réglementé d'un État partie à l'accord sur l'Espace économique européen.

Article 4. Modalité de transmission des déclarations

I. - Les modalités de transmission par l'entreprise de marché des déclarations portant sur les ordres reçus et les transactions effectuées dans les systèmes du marché réglementé qu'elle gère sont fixées au cas par cas avec l'entreprise de marché concernée.

II. - Les modalités de transmission par le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation des déclarations sont fixées au cas par cas pour chaque système multilatéral de négociation pour les ordres sur des instruments financiers mentionnés à l'article L. 211-1 du code monétaire et financier admis aux négociations sur un marché réglementé d'un État partie à l'accord sur l'Espace économique européen et pour les transactions portant sur des instruments financiers qui ne sont pas admis aux négociations sur un marché réglementé d'un État partie à l'accord sur l'Espace économique européen.

III. - Le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation transmet les déclarations portant sur les transactions effectuées dans ses systèmes sur des instruments financiers admis aux négociations sur un marché réglementé d'un État partie à l'Espace économique européen :

1° En recourant au système déclaratif de l'AMF (Reporting Direct des Transactions) dans les conditions et selon le format définis par l'AMF dans le cahier des charges de ce système,

2° Ou, le cas échéant, selon les modalités techniques mises en place, en accord avec l'AMF, par l'entreprise de marché gérant un marché réglementé français conformément au I du présent article ou par le gestionnaire d'un système multilatéral de négociation conformément au II ci-dessus.

Article 5. Délais de déclaration

Les déclarations sont adressées à l'AMF selon une fréquence quotidienne et au plus tard le jour ouvré suivant la date de la présentation dans les systèmes pour les ordres et la date d'exécution pour les transactions.

Article 6. Corrections et annulations

La déclaration à l'AMF de la correction ou de l'annulation de transactions déjà déclarées doit être effectuée dans les plus brefs délais en renseignant l'indicateur approprié et selon les mêmes modalités de transmission.

Les annulations et corrections peuvent être transmises en même temps que les déclarations du jour ouvré suivant.