
Norme internationale



7775/2

INTERNATIONAL ORGANIZATION FOR STANDARDIZATION • МЕЖДУНАРОДНАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ ПО СТАНДАРТИЗАЦИИ • ORGANISATION INTERNATIONALE DE NORMALISATION

**Valeurs mobilières — Structure des types de messages —
Partie 2: Ordre d'achat/de vente**

Securities — Scheme for message types — Part 2: Order to buy/sell

Première édition — 1986-02-01

CDU 336.763

Réf. n° : ISO 7775/2-1986 (F)

Descripteurs : banque, document bancaire, paiement interbancaire, valeur mobilière, instruction.

Avant-propos

L'ISO (Organisation internationale de normalisation) est une fédération mondiale d'organismes nationaux de normalisation (comités membres de l'ISO). L'élaboration des Normes internationales est confiée aux comités techniques de l'ISO. Chaque comité membre intéressé par une étude a le droit de faire partie du comité technique créé à cet effet. Les organisations internationales, gouvernementales et non gouvernementales, en liaison avec l'ISO participent également aux travaux.

Les projets de Normes internationales adoptés par les comités techniques sont soumis aux comités membres pour approbation, avant leur acceptation comme Normes internationales par le Conseil de l'ISO. Les Normes internationales sont approuvées conformément aux procédures de l'ISO qui requièrent l'approbation de 75 % au moins des comités membres votants.

La Norme internationale ISO 7775/2 a été élaborée par le comité technique ISO/TC 68, *Banque*.

L'attention des utilisateurs est attirée sur le fait que toutes les Normes internationales sont de temps en temps soumises à révision et que toute référence faite à une autre Norme internationale dans le présent document implique qu'il s'agit, sauf indication contraire, de la dernière édition.

Sommaire

	Page
0 Introduction	1
1 Objet et domaine d'application	1
2 Références	1
3 Définitions	1
4 Structure des codes des types de message	3
5 Conventions de représentation des formats des textes de messages normalisés	4
6 Table de zones	5
7 Description des zones	5
8 Contenu des messages	10
 Annexes	
A Type de message — Exemple A	13
B Type de message — Exemple B	15

iTeh STANDARD PREVIEW
(standards.iteh.ai)

ISO 7775-2:1986

<https://standards.iteh.ai/catalog/standards/sist/ab88aba4-d214-4e80-889d-647715c47ee8/iso-7775-2-1986>

Valeurs mobilières — Structure des types de messages — Partie 2: Ordre d'achat/de vente

0 Introduction

L'ISO 7775/1 traite des instructions de réception et de livraison de titres et des messages qui s'y rapportent. La présente partie de l'ISO 7775 traite des ordres d'achat et de vente et des confirmations et avis d'exécution correspondants. À l'heure actuelle, les ordres sont transmis pour la plupart par téléphone ou par télex, et les confirmations et avis d'exécution par télex ou par imprimés. Les types de messages normalisés et leurs formats devraient cependant faciliter les opérations internationales, en particulier en raison de l'utilisation croissante des télétransmissions d'ordinateur à ordinateur.

1 Objet et domaine d'application

La présente partie de l'ISO 7775 décrit les types de messages [c'est-à-dire les ordres d'achat et de vente et les confirmations et avis d'exécution correspondants (voir chapitre 3)] devant être utilisés, pour les transmissions internationales, par tous les organismes engagés professionnellement dans les affaires de titres, en particulier les banques et les agents de change, ainsi que les institutions supra-nationales de compensation de titres.

Les types de messages définis dans l'ISO 7775 sont des instructions qui sont généralement formulées par écrit et qui sont transmises par imprimés, par télex ou par télétransmission de données. L'ISO 7775 s'applique à chacune de ces utilisations. Cependant, les conventions pour le format des zones de messages telles que décrites dans le chapitre 7, sont réservées aux données télétransmises. Dans le cas des messages par télex et par télétransmission de données, des spécifications supplémentaires liées aux systèmes de transmissions peuvent exister, mais elles ne sont pas reprises dans l'ISO 7775.

L'ISO 7775 traite seulement des messages simples. En pratique, il y a souvent plusieurs messages individuels regroupés dans une transmission. La méthode de regroupement peut être définie par les parties concernées. Cependant, le texte des messages individuels contenus dans la transmission devrait être conforme aux règles prévues dans l'ISO 7775.

2 Références

ISO 2014, *Représentation numérique des dates*

ISO 3166, *Codes pour la représentation des noms de pays.*

ISO 4217, *Codes pour la représentation des monnaies et types de fonds.*

ISO 6166, *Valeurs mobilières — Système international de numérotation pour l'identification des valeurs mobilières (ISIN).*

3 Définitions

Dans le cadre de la présente partie de l'ISO 7775, les définitions suivantes sont applicables.

3.1 message: Communication, d'un expéditeur à un destinataire, contenant une série d'éléments relatifs à une opération/transaction sur titres.

3.2 Types de messages (MT)

3.2.1 ordre d'achat: Instruction envoyée par le client, ou par son représentant mandaté, d'acheter une quantité donnée d'une valeur identifiée, sous certaines conditions.

NOTE — Quand des instructions de règlement ne sont pas spécifiées, des instructions permanentes pour la livraison et le paiement s'appliquent. Ce message est normalement le premier dans une chaîne d'opérations/transactions et, par conséquent, il n'est pas prévu de se référer à un autre message ou à une autre opération/transaction.

3.2.2 ordre de vente: Instruction envoyée par le client, ou par son représentant mandaté, de vendre une quantité donnée d'une valeur identifiée, sous certaines conditions.

NOTE — Quand des instructions de règlement ne sont pas spécifiées, des instructions permanentes pour la livraison et le paiement s'appliquent. Ce message est normalement le premier dans une chaîne d'opérations et, par conséquent, il n'est pas prévu de se référer à un autre message ou à une autre opération/transaction.

3.2.3 confirmation d'achat ou de vente: Confirmation envoyée par l'exécuteur de l'ordre fournissant tous les détails comptables, aussi bien pour les titres que pour le règlement en espèces de la négociation.

NOTE — Il est précisé par un code dans la zone 023 « Identification supplémentaire » s'il s'agit d'un achat ou d'une vente. Quand un ordre d'achat ou un ordre de vente est exécuté en plusieurs parties, normalement une confirmation d'achat ou de vente doit être envoyée pour chaque journée d'exécution et, au cours de chaque journée, pour chaque prix de négociation si tous les autres détails à préciser sont identiques.

3.2.4 avis provisoire d'exécution: Annonce envoyée par l'exécuteur d'ordre pour donner des informations brèves mais immédiates au sujet d'une négociation de titres.

NOTE — Il est précisé par un code dans la zone 023 « Identification supplémentaire » s'il s'agit d'un achat ou d'une vente. Pour adresser des détails complets lorsqu'ils sont disponibles, une confirmation d'achat ou de vente (MT 510) est utilisée.

3.2.5 message de demande de modification: Message utilisé pour modifier un message précédent.

NOTE — Il n'est pas permis de modifier le contenu des zones 35A «Quantité de titres», 35B «Désignation de la valeur» et 35E/35F «Numéro(s) de titre(s) ou de série(s)» ou de modifier plus d'une zone du message d'origine en utilisant un message de demande de modification (MT 578). Dans ces cas, le message d'origine devrait être annulé et réémis. La quantité de titres et la désignation de la valeur du message d'origine devraient être répétées sauf si ce dernier était d'un type tel qu'il rende ces informations superflues, par exemple relevés de titres. Si le message à modifier comprend les zone 023 «Identification supplémentaire», 35A «Quantité de titres» et 35B «Désignation de la valeur», elles devraient être incluses sans changement dans la demande de modification. Le message de demande de modification doit être accepté par le destinataire, qui devrait aviser rapidement l'expéditeur dans le cas où la demande n'est pas acceptée. Pour une annulation complète, le message de demande d'annulation, (MT 592) devrait être utilisé.

3.2.6 message de demande d'annulation: Message utilisé pour annuler un message précédent.

NOTE — La quantité de titres et la désignation de la valeur du message d'origine devraient être répétées sauf si ce dernier était d'un type tel qu'il rend ces informations superflues, par exemple relevé de titres. Un

message de demande d'annulation doit être accepté par le destinataire. Le destinataire devrait aviser rapidement l'expéditeur dans le cas où la demande n'est pas acceptée.

3.2.7 message de demande d'information: Message utilisé pour demander des détails supplémentaires au sujet d'un message précédent.

3.2.8 message de réponse: Réponse à un message de demande de modification, ou à un message de demande d'annulation ou à un message de demande d'information.

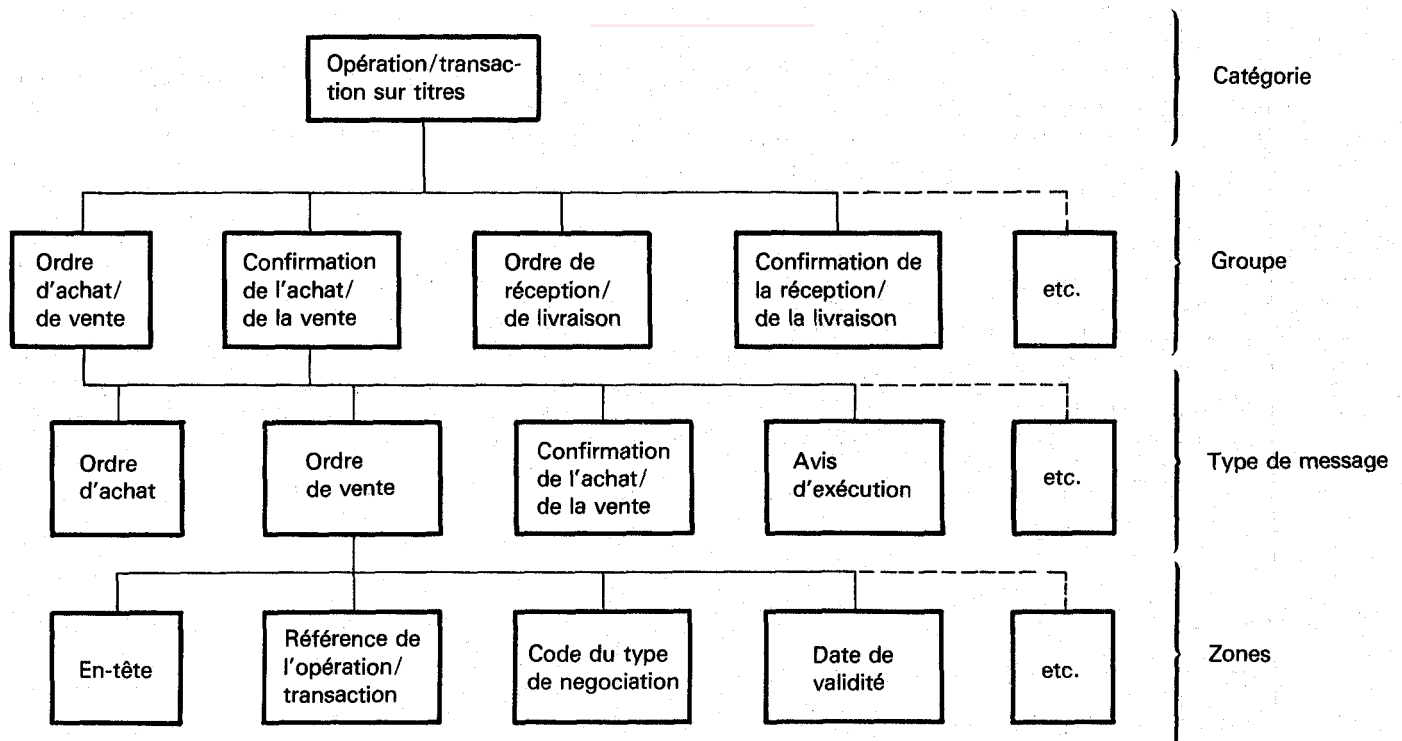
3.3 Autres définitions

3.3.1 étiquette de zone: Étiquette utilisée à la place de la zone et indépendante du langage.

NOTE — C'est toujours un code à trois caractères. Les caractères peuvent être deux chiffres et une lettre majuscule en troisième position. La présence d'une lettre minuscule en dernière position signifie que différentes options existent en utilisant ce code et qu'elles sont décrites dans le chapitre 7. Un «s» minuscule est utilisé pour indiquer que différents formats («A» à «F») existent pour une zone.

3.3.2 format: Description des limitations dans l'utilisation des zones.

Schéma



4 Structure des codes des types de messages

Les types de messages sont identifiés par un numéro à trois chiffres dont la structure est la suivante :

Code:

y - - = catégorie

y x - = groupe

y x n = type

4.1 Catégorie

x =

5 = valeurs mobilières

x =

4.2 Groupe

0 = ordre d'achat/de vente

1 = confirmation d'achat ou de vente

2 = ordres de réception et de livraison

3 = confirmation/avis de réception/de livraison

4 = réservé pour une future définition

5 = réservé pour une future définition

6 = réservé pour une future définition

7 = divers

8 = réservé pour une future définition

9 = divers

Les organisations désireuses d'utiliser les codes 4, 5, 6 et 8 doivent s'adresser au comité technique de l'ISO responsable de l'ISO 7775.

4.3 Types de messages

50n: Ordre d'achat/de vente

500 Ordre d'achat

501 Ordre de vente

51n: Confirmation d'achat ou de vente

510 Confirmation d'achat ou de vente

519 Avis provisoire d'exécution

57n/59n: Divers¹⁾

578 Demande de modification

592 Demande d'annulation

595 Demande d'information

596 Réponse

1) Mentionnés à titre indicatif uniquement. Les messages sont les mêmes que dans l'ISO 7775/1.

5 Conventions de représentation des formats des textes de messages normalisés

5.1 Représentation des caractères

Les caractères utilisés dans une zone doivent être des caractères définis par des Normes internationales, sauf en ce qui concerne les codes de contrôle de communication ou les codes de séparation de zones.

n: chiffres

a: lettres

á: lettres et chiffres

x: tous caractères possibles y compris les blancs

d: représente une valeur numérique qui prend toujours la même forme. La partie entière doit contenir au moins un chiffre. La partie décimale peut être omise mais la virgule des décimales doit rester. La virgule des décimales peut être précédée d'un zéro (0). Aucun espace blanc ni aucun autre symbole ne sont permis.

b: représente un espace blanc

5.2 Indications de longueur

nn: longueur fixe

nn: longueur maximum

nn * nn: nombre maximum de sous-zones (= lignes) et longueur maximale d'une sous-zone

nn - nn: longueur minimum et maximum

nn,nn: la longueur comprend la virgule des décimales

5.3 Délimitations de sous-zones

Dans la définition du format d'une zone particulière, les sous-zones facultatives doivent apparaître entre parenthèses.

5.4 Représentation des adresses

La première position de la ligne du numéro de compte doit être une barre oblique « / ».

Les adresses doivent être représentées selon l'une des six manières suivantes:

A — Ligne du numéro de compte et identificateur du système utilisé	[/34x] 16x
B — Ligne du numéro de compte et identificateur de la succursale	[/34x] 35x
C — Ligne du numéro de compte seulement	/34x
D — Ligne du numéro de compte et adresse postale	[/34x]
— nom/rue	4 * 35x
— code postal	
— ville/état/pays	
E — Code FREE (GRATUIT) ou APMT (CONTRE PAIEMENT) et ligne du numéro de compte et identification du système utilisé	4a [/34x] 16x
F — Code FREE (GRATUIT) ou APMT (CONTRE PAIEMENT) et ligne du numéro de compte et adresse postale	4a
— nom/rue	[/34x]
— code postal	4 * 35x
— ville/état/pays	

5.5 Numéro(s) de titre(s) ou de série(s)

Ils doivent être représentés suivant les options E ou F :

E = 6 * 50x

F = 35 * 50x

5.6 Représentation des noms de monnaies et de pays

Lorsque des noms de monnaies et de pays sont spécifiés dans les messages, le code alphabétique à 3 lettres (ISO 4217) doit être utilisé pour les monnaies et le code à 2 lettres (ISO 3166) doit être utilisé pour les noms de pays.

6 Table des zones

Étiquette de zone	Description des zones	Voir
-	En-tête	7.1
011	Type de message et date du message d'origine	7.2
020	Référence de l'opération/transaction	7.3
021	Référence de l'opération/transaction d'origine	7.4
023	Identification supplémentaire	7.5
030	Date de validité de l'ordre/Date de règlement	7.6
31P	Date et place de négociation	7.7
32B	Montant du règlement	7.8
32M	Montant brut de la négociation	7.9
32S	Date et cours d'exercice	7.10
32L	Cours limite	7.11
33S	Rétrocessions	7.12
33T	Cours de négociation	7.13
34i	Intérêts courus	7.14
34r	Montant net	7.15
35n	Spécification des titres (quantité, désignation, prochain coupon)	7.16
35E	Numéro(s) de titre(s) ou de série(s)	7.17
036	Taux de change	7.18
52s	Donneur d'ordre	7.19
59s	Bénéficiaire des fonds	7.20
71B	Frais de l'expéditeur du message	7.21
71C	Autres frais	7.22
71D	Compte(s) pour frais	7.23
072	Informations complémentaires au destinataire du message	7.24
074	Demande de modification	7.25
075	Demande d'information	7.26
076	Réponse	7.27
83s	Compte pour paiement	7.28
84s	Destinataire/Expéditeur des titres	7.29
85s	Bénéficiaire des titres	7.30
-	Fin de message	7.31

7 Description des zones

Étiquette de zone	Description	Format
7.1	- En-tête L'en-tête dépend du système de transmission utilisé et doit identifier, au minimum, l'expéditeur, le destinataire, la date du message et le type du message. En plus, sur la base d'accords bilatéraux, une clé de contrôle peut être utilisée comme moyen de sécurité. L'en-tête précède immédiatement le texte du message.	
7.2	011 Type de message et date du message d'origine Cette zone identifie à sa première ligne par le code à trois chiffres (5xn) le type du message qui doit être modifié/annulé ou pour lequel une interrogation est demandée et donne à sa seconde ligne la date à laquelle ce message avait été envoyé.	3n 6n
7.3	020 Référence de l'opération/transaction Cette zone donne un identificateur unique d'une opération/transaction et est attribuée par l'expéditeur.	16x

Étiquette de zone	Description	Format
7.4	<p>021 Référence de l'opération/transaction d'origine Cette zone est utilisée pour relier un message aux autres parties d'une opération/transaction, c'est-à-dire que dans la réponse à un message qui vient d'arriver le contenu de la zone 020 de ce message doit être donné.</p>	16x
7.5	<p>023 Identification supplémentaire Le contenu de cette zone dépend du type d'instruction:</p> <p>a) Dans un ordre d'achat/de vente cette zone doit spécifier les types particuliers de négociation concernés. Les noms des codes suivants peuvent être utilisés:</p> <p>FORWARD (terme): Exécuté ou à être exécuté pour règlement à une date future déterminée en accord avec les pratiques de cette bourse ou marché.</p> <p>OPTION: Le droit d'acheter ou de vendre à l'intérieur d'une période fixée à un prix déterminé. Ce code peut être suivi par la qualification NON ou NEG, respectivement pour les options non négociables ou négociables, par exemple OPTIONNON.</p> <p>PREMIUM (prime): Le droit d'acheter un titre en fonction de dates et de prix planifiés.</p> <p>REGULAR (normal): Exécuté ou à être exécuté en accord avec les pratiques normales de cette bourse ou de ce marché particuliers.</p> <p>SPOT (comptant): Exécuté ou à être exécuté avec un règlement immédiat en accord avec les pratiques de cette bourse ou ce marché particuliers.</p> <p>STELLAGE: Le droit d'acheter ou de vendre à l'intérieur d'une période fixée à un prix déterminé et une obligation d'exécuter l'une des alternatives.</p> <p>b) Dans un avis d'exécution/une confirmation d'un ordre d'achat/de vente, cette zone doit comporter un code pour le type de négociation, BOUGHT (acheté) ou SOLD (vendu). En plus, après une barre, l'un des noms des codes mentionnés en a) peut être utilisé.</p>	16x
7.6	<p>030 Dans les types de message 500/501 : Date de validité de l'ordre Cette zone précise la date, incluse, jusqu'à laquelle l'ordre est valable. L'absence de cette zone signifie que les usages de la place du destinataire s'appliquent, à moins que des instructions soient données dans la zone 072 « Informations complémentaires au destinataire du message ».</p> <p>Dans le type de message 510: Date de règlement Cette zone donne la date à laquelle les titres ou les fonds doivent être échangés.</p>	6n
7.7	<p>31P Date et place de négociation Cette zone indique le jour pendant lequel la négociation a été exécutée. La place, quand elle est indiquée, doit identifier la bourse ou autre marché sur lequel la négociation a été exécutée.</p>	6n [29x]
7.8	<p>32B Montant du règlement Cette zone comprend le code monnaie et le montant total à payer ou à recevoir en échange des titres.</p>	3a 15d
7.9	<p>32M Montant brut de la négociation Cette zone indique le prix de négociation multiplié par la quantité de titres.</p>	3a 15d
7.10	<p>32S Date et cours d'exercice Cette zone doit être seulement utilisée pour les négociations avec options et à primes. Le cours auquel le titre peut être acheté ou vendu au/ou avant le dénouement et le code monnaie doivent apparaître dans cette zone et le cours limite dans la zone 32L « Cours limite ».</p> <p>Le dernier jour pendant lequel l'option peut être exercée doit être indiqué dans la première sous-zone. Dans une confirmation/un avis d'exécution, cette zone doit donner le cours du contrat réel et doit être utilisée, que ce prix soit différent ou non du cours du contrat donné dans l'ordre d'achat ou de vente.</p>	6n 3a 12d

Étiquette de zone	Description	Format
7.11	32L Cours limité Cette zone indique une limitation de prix pour l'ordre. Elle comprend le code monnaie et le prix ou le pourcentage de prix. Dans le cas de pourcentage de prix, utiliser PCT au lieu du code monnaie. Dans le cas où le prix est basé sur le montant du revenu, utiliser le code RTE au lieu du code monnaie. Les fractions telles que 3/16 doivent être exprimées sous la forme décimale, c'est-à-dire 0,1875. Jusqu'à six chiffres sont permis après la virgule obligatoire des décimales. Dans une ligne additionnelle, des indications supplémentaires telles que « stop loss » (ou « at market ») peuvent être données. Quand aucun prix n'est mentionné, utiliser seulement la seconde ligne pour donner des instructions d'exécution telles que « at market ».	[3a 15d] [35x]
7.12	33S Rétrocessions Cette zone indique la monnaie et le montant de commission, de rétrocession ou de toute réduction du prix de négociation. Quand elle est indiquée par un pourcentage, la mention PCT apparaît comme code monnaie et le pourcentage figure sous la forme décimale.	3a 15d
7.13	33T Cours de négociation Cette zone comprend le code monnaie et le prix ou le pourcentage du prix de négociation. Dans le cas de pourcentage, la mention PCT est utilisée comme code monnaie. Dans le cas où le prix doit être basé sur le montant du revenu du titre, la mention RTE est utilisée comme code monnaie.	3a 15d
7.14	34i Intérêts courus Cette zone indique le nombre de jours, quand nécessaire, le code monnaie et le montant des intérêts en cours, par exemple dans le cas d'obligations. L'option G signifie que le montant doit être ajouté, et l'option H que le montant doit être déduit au/du montant brut de la négociation.	[3n] 3a 15d
7.15	34r Montant net Cette zone indique le montant total crédité/débité au compte: Option A = signifie date de valeur, code monnaie et montant Option B = signifie code monnaie et montant Le montant résulte du calcul Montant du règlement + / - tous frais = montant net.	6n 3a 15d 3a 15d
7.16	35n Spécification des titres La spécification des titres est donnée par quatre définitions de « n »: n = A = quantité de titres n = B = désignation de la valeur n = C = prochain coupon (numéro) n = D = prochain coupon (date de paiement)	
7.16.1	35A Quantité de titres Cette zone donne la spécification des titres et leur quantité. La spécification des titres est réalisée par l'utilisation de l'un des codes suivants: FMT — montant facial ou principal ou nominal OPC — contrats d'option OPS — actions faisant l'objet d'option PRC — contrats de primes PRS — actions à primes SHS — actions UNT — unités, par exemple consistant d'une obligation et d'un warrant RTS — droits WTS — warrants BON — obligations (quand elles ne sont pas négociées par leur valeur faciale) MSC — divers	3a 15d