

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/577**z dne 13. junija 2016****o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta o trgih finančnih instrumentov v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi za mehanizem največjega obsega in zagotavljanje informacij za izračune za preglednost in druge namene****(Besedilo velja za EGP)**

EVROPSKA KOMISIJA JE –

ob upoštevanju Pogodbe o delovanju Evropske unije,

ob upoštevanju Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 15. maja 2014 o trgih finančnih instrumentov in spremembi Uredbe (EU) št. 648/2012 ⁽¹⁾ ter zlasti člena 5(9) in člena 22(4) Uredbe,

ob upoštevanju naslednjega:

- (1) Uredba (EU) št. 600/2014 določa, da morajo pristojni organi in Evropski organ za vrednostne papirje in trge (ESMA) opraviti znatno število izračunov za umeritev uporabe sistema preglednosti pred trgovanjem in po njem ter obveznosti trgovanja z izvedenimi finančnimi instrumenti kot tudi za ugotovitev, ali je investicijsko podjetje sistematični internalizator.
- (2) Pristojni organi in ESMA morajo imeti za izvedbo potrebnih izračunov dostop do zanesljivih in visokokakovostnih podatkov za vsak razred finančnih instrumentov, za katerega se uporablja Uredba (EU) št. 600/2014. Zato je treba izboljšati dostopnost in kakovost podatkov, ki so na voljo pristojnim organom in ESMA v skladu z Direktivo 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta ⁽²⁾ ter Uredbo (EU) št. 600/2014, tako da se lahko razvrščanje finančnih instrumentov v razrede, vključno s pragi za namene preglednosti pred trgovanjem in po njej, ter po potrebi ponovno umerjanje teh pragov izračunata na podlagi več informacij, potem ko se bo sistem že nekaj časa uporabljal.
- (3) Treba bi bilo uvesti določbe, v katerih bodo na splošno določeni skupni elementi v zvezi z vsebino in obliko podatkov, ki jih morajo predložiti mesta trgovanja, sistemi odobrenih objav (APA) in ponudniki stalnih informacij (CTP) za izračune za preglednost in druge namene. Te določbe bi se morale brati skupaj z delegiranimi uredbami Komisije (EU) 2017/587 ⁽³⁾, (EU) 2017/583 ⁽⁴⁾, (EU) 2017/567 ⁽⁵⁾, (EU) 2017/565 ⁽⁶⁾ in (EU) 2016/2020 ⁽⁷⁾, v katerih so opisani metodologija in podatki, ki so potrebni za izvajanje zadevnih izračunov, ter določena vsebina in obseg podatkov, ki so potrebni za izračune, povezane s preglednostjo. Zato bi morale biti pri izvajanju teh

⁽¹⁾ UL L 173, 12.6.2014, str. 84.

⁽²⁾ Direktiva 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta z dne 15. maja 2014 o trgih finančnih instrumentov ter spremembi Direktive 2002/92/ES in Direktive 2011/61/EU (UL L 173, 12.6.2014, str. 349).

⁽³⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/587 z dne 14. julija 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta o trgih finančnih instrumentov v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o zahtevah po preglednosti za mesta trgovanja in investicijska podjetja v zvezi z delnicami, potrdili o lastništvu, investicijskimi skladi, s katerimi se trguje na borzi, certifikati in drugimi podobnimi instrumenti ter o obveznostih glede izvrševanja poslov z določenimi delnicami na mestu trgovanja ali s strani sistematičnega internalizatorja (glej stran 387 tega Uradnega lista).

⁽⁴⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/583 z dne 14. julija 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o zahtevah glede preglednosti za mesta trgovanja in investicijska podjetja v zvezi z obveznicami, strukturiranimi finančnimi produkti, pravicami do emisij in izvedenimi finančnimi instrumenti (glej stran 229 tega Uradnega lista).

⁽⁵⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/567 z dne 18. maja 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z opredelitvijo pojmov, preglednostjo, stiskanjem portfelja ter nadzornimi ukrepi glede poseganja v zvezi s produkti in pozicij (glej stran 90 tega Uradnega lista).

⁽⁶⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/565 z dne 25. aprila 2016 o dopolnitvi Direktive 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z organizacijskimi zahtevami in pogoji poslovanja investicijskih podjetij ter opredeljenimi izrazi za namene navedene direktive (glej stran 1 tega Uradnega lista).

⁽⁷⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2016/2020 z dne 26. maja 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta o trgih finančnih instrumentov v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o merilih za določitev, ali bi za izvedene finančne instrumente, za katere velja obveznost kliringa, morala veljati obveznost trgovanja (UL L 313, 19.11.2016, str. 2).

izračunov vsebina, oblika in kakovost podatkov, predloženih v zvezi z mesti trgovanja, APA in CTP, skladne z veljavno metodologijo, določeno v ustreznih izvedbenih aktih Direktive 2014/65/EU in Uredbe (EU) št. 600/2014.

- (4) Z izjemo morebitnih priložnostnih zahtevkov za podatke in izračunov, ki jih je treba opraviti za namene mehanizma največjega obsega, bi morali mesta trgovanja, APA in CTP predložiti poročila vsak dan. Glede na velik obseg zajetih finančnih instrumentov in velike količine podatkov, ki jih je treba obdelati, ta dnevna predložitev poročil pristojnim organom omogoča, da natančneje obdelajo datoteke obvladljivih velikosti, ter zagotavlja učinkovito in pravočasno upravljanje predložitve podatkov, preverjanja njihove kakovosti in njihove obdelave. Dnevno zbiranje podatkov poenostavlja tudi obveznost zagotavljanja podatkov za mesta trgovanja, APA in CTP z zmanjšanjem njihovega bremena pri izračunavanju števila dni trgovanja, kadar se uporablja kvantitativno merilo za likvidnost, in pri združevanju podatkov za isti finančni instrument v različnih časovnih žepkih zapadlosti, kadar je treba upoštevati čas do zapadlosti. Centralizacija tega izračuna tudi zagotavlja dosledno uporabo meril pri vseh finančnih instrumentih in mestih trgovanja.
- (5) Mesta trgovanja bi morala hraniti izčrpne podatke, ki pristojnim organom in ESMA omogočajo izvajanje točnih izračunov. Čeprav se zahtevane informacije običajno zagotovijo v poročilih po trgovanju, pa so v nekaterih primerih za izračune potrebne informacije, ki presegajo razpoložljive informacije v poročilih. To na primer vključuje informacije o poslih, izvršenih na podlagi naročil, pri katerih se izkoristi opustitev za velik tržni obseg. Poročila o trgovanju ne bi smela vsebovati teh informacij, saj bi lahko te posle izpostavila škodljivemu tržnemu učinku. Ker pa pristojni organi te informacije morda potrebujejo za izvedbo natančnih izračunov, bi jih morala mesta trgovanja, APA in CTP ustrezno hraniti in jih po potrebi sporočiti pristojnim organom in ESMA. Mesta trgovanja bi morala zagotoviti, da ustrezno razširjajo informacije, ki jih je treba zagotoviti pristojnim organom in ESMA. Posli, izvršeni na podlagi velikih naročil, bi morali biti ustrezno označeni v njihovem poročilu, namenjenem CTP.
- (6) Podatke bi bili treba zbirati iz različnih virov, saj en sam vir morda nima vedno popolnega niza podatkov za posamezen razred finančnih instrumentov ali celo za posamezen instrument. Zato bi morala mesta trgovanja, APA in CTP zaradi lažjega in stroškovno učinkovitejšega zbiranja podatkov uporabljati vnaprej določene specifikacije v smislu vsebine in oblike, kjer so na voljo, da se pristojnim organom in ESMA omogoči, da pridobijo in konsolidirajo visokokakovostne podatke iz različnih virov.
- (7) Ob upoštevanju občutljivosti potrebnih izračunov in morebitnih gospodarskih posledic objave netočnih informacij za mesta trgovanja, izdajatelje in druge tržne udeležence, ki bi lahko v primeru mehanizma največjega obsega privedla do začasnega preklica uporabe opustitev za posamezno mesto trgovanja ali po vsej Uniji za določen finančni instrument, je bistveno določiti obliko, v kateri se podatki predložijo pristojnim organom in ESMA, da se vzpostavijo učinkovite komunikacijske poti z mesti trgovanja in CTP ter zagotovi pravočasna in pravilna objava zahtevanih podatkov.
- (8) Uredba (EU) št. 600/2014 določa, da mora ESMA za finančne instrumente, za katere se uporablja mehanizem največjega obsega, objaviti podatke o izmerjenem celotnem obsegu trgovanja v preteklih 12 mesecih in odstotke trgovanja tako za opustitve pri dogovorjeni ceni kot pri referenčni ceni za celotno Unijo in za vsako mesto trgovanja v preteklih 12 mesecih. V primeru finančnih instrumentov, s katerimi se trguje v več kot eni valuti, je treba obsege trgovanja, izvršene v različnih valutah, pretvoriti v enotno valuto, da se omogoči izračun navedenih obsegov in izvedejo potrebni izračuni. Zato bi bilo treba zagotoviti metodologijo in menjalne tečaje, ki se uporabljajo za pretvorbo obsega trgovanja, kadar je to potrebno.
- (9) Za namene mehanizma največjega obsega bi bilo treba od mest trgovanja zahtevati, da poročajo o obsegu trgovanja, izvršenem na podlagi opustitve pri referenčni ceni, za likvidne instrumente pa o opustitvi pri dogovorjeni ceni. Ker se opustitve uporabljajo za naročila in ne za posle, je pomembno pojasniti, da bi moral obseg, o katerem je treba poročati, vključevati vse posle, označene z „RFPT“ ali „NLIQ“, za namen objave poslov po trgovanju in kot je določeno v Delegirani uredbi (EU) 2017/587. Če je bil posel izvršen na podlagi dveh naročil, pri katerih je bila uporabljena opustitev za velik tržni obseg, se ta posel ne bi smel upoštevati pri obsegu trgovanja, izračunanem na podlagi opustitve pri referenčni ceni in opustitve pri dogovorjeni ceni.
- (10) Za namene mehanizma največjega obsega bi morali mesta trgovanja in CTP zagotoviti, da je mesto trgovanja, kjer je bil posel izvršen, opredeljeno dovolj natančno, da lahko ESMA opravi vse izračune iz Uredbe (EU) št. 600/2014. Zlasti bi se moral za posamezno mesto trgovanja uporabljati edinstven identifikator, ki se ne bi

smel uporabljati za nobeno drugo mesto trgovanja, ki ga upravlja isti upravljavec trga. Identifikatorji mest trgovanja bi morali ESMA omogočiti, da nedvoumno loči vsa mesta trgovanja, za katera je upravljavec trga prejel posebno dovoljenje v skladu z Direktivo 2014/65/EU.

- (11) Za namene mehanizma največjega obsega je treba od mest trgovanja zahtevati, da prvo poročilo predložijo na dan začetka uporabe Direktive 2014/65/EU ter Uredbe (EU) št. 600/2014, v njem pa za preteklo koledarsko leto navedejo obseg trgovanja, izvršenega na podlagi opustitve pri referenčni ceni, in za likvidne finančne instrumente na podlagi opustitve pri dogovorjeni ceni. Za zagotovitev sorazmerne uporabe te zahteve bi morala mesta trgovanja v ta namen svoja poročila pripraviti na podlagi prilagojenega obsega trgovanja, izvršenega v okviru enakovrednih opustitev, določenih v Direktivi 2004/39/ES Evropskega parlamenta in Sveta ⁽¹⁾ ter Uredbi Komisije (ES) št. 1287/2006 ⁽²⁾.
- (12) Da se pristojnim organom in ESMA zagotovijo točni podatki, bi morali mesta trgovanja, APA in CTP zagotoviti, da njihova poročila vsebujejo samo posle, izračunane z enojnim štejem.
- (13) Določbe te uredbe so tesno povezane, saj obravnavajo določanje vsebine, pogostosti in oblike zahtevkov za podatke, metode, uporabljene za obdelavo teh podatkov, in drugih specifikacij, povezanih z objavo informacij, za namene preglednosti, kot je opredeljeno v Uredbi (EU) št. 600/2014. Za zagotovitev skladnosti navedenih določb, ki bodo začele veljati hkrati, in da se zainteresiranim stranem ter zlasti tistim, za katere veljajo obveznosti, olajša celovit pregled nad določbami, je zaželeno, da se vključijo v eno uredbo.
- (14) Zaradi doslednosti in za zagotavljanje nemotenega delovanja finančnih trgov je nujno, da se določbe iz te uredbe in določbe iz Uredbe (EU) št. 600/2014 uporabljajo od istega datuma.
- (15) Ta uredba temelji na osnutkih regulativnih tehničnih standardov, ki jih je ESMA predložila Komisiji.
- (16) ESMA je o osnutkih regulativnih tehničnih standardov, na katerih temelji ta uredba, opravila javna posvetovanja, analizirala morebitne z njimi povezane stroške in koristi ter zaprosila za mnenje interesno skupino za vrednostne papirje in trge, ustanovljeno v skladu s členom 37 Uredbe (EU) št. 1095/2010 Evropskega parlamenta in Sveta ⁽³⁾ –

SPREJELA NASLEDNJO UREDBO:

Člen 1

Predmet urejanja in področje uporabe

1. Ta uredba določa podrobnosti zahtevkov za podatke, ki jih pošljejo pristojni organi, in podrobnosti, ki jih v odgovoru na te zahteve pošljejo mesta trgovanja, sistemi odobrenih objav (APA) in ponudniki stalnih informacij (CTP), za izračun in prilagoditev sistema preglednosti pred trgovanjem in po njem ter ureditve obveznosti trgovanja, in zlasti za določitev naslednjih dejavnikov:

- (a) ali imajo lastniški, lastniškim podobni in nelastniški finančni instrumenti likviden trg;
- (b) pragov za opustitev preglednosti pred trgovanjem za lastniške, lastniškim podobne in nelastniške finančne instrumente;

⁽¹⁾ Direktiva 2004/39/ES Evropskega parlamenta in Sveta z dne 21. aprila 2004 o trgih finančnih instrumentov in o spremembah Direktiv Sveta 85/611/EGS, 93/6/EGS in Direktive 2000/12/ES Evropskega parlamenta in Sveta ter o razveljavitvi Direktive Sveta 93/22/EGS (UL L 145, 30.4.2004, str. 1).

⁽²⁾ Uredba Komisije (ES) št. 1287/2006 z dne 10. avgusta 2006 o izvajanju Direktive 2004/39/ES Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z obveznostmi vodenja evidenc za investicijske družbe, poročanjem o transakcijah, tržno preglednostjo, sprejemanjem finančnih instrumentov v trgovanje in pojmi, opredeljenimi v navedeni direktivi (UL L 241, 2.9.2006, str. 1).

⁽³⁾ Uredba (EU) št. 1095/2010 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 24. novembra 2010 o ustanovitvi Evropskega nadzornega organa (Evropski organ za vrednostne papirje in trge) in o spremembi Sklepa št. 716/2009/ES ter razveljavitvi Sklepa Komisije 2009/77/ES (UL L 331, 15.12.2010, str. 84).

- (c) pragov za opustitev preglednosti po trgovanju za lastniške, lastniškimi podobne in nelastniške finančne instrumente;
- (d) kdaj se likvidnost razreda finančnih instrumentov zniža pod določen prag;
- (e) ali je investicijsko podjetje sistematični internalizator;
- (f) standardnega tržnega obsega, ki se uporablja za sistematične internalizatorje, ki se ukvarjajo z lastniškimi in lastniškimi podobnimi instrumenti, ter obseg, ki je značilen za instrument, ki se uporablja za sistematične internalizatorje, ki se ukvarjajo z nelastniškimi instrumenti;
- (g) za lastniške in lastniškimi podobne instrumente celotni obseg trgovanja v preteklih 12 mesecih in odstotke trgovanja, izvršenega na podlagi opustitev pri dogovorjeni ceni in opustitev pri referenčni ceni za Unijo kot celoto in za vsako mesto trgovanja v preteklih 12 mesecih;
- (h) ali so izvedeni finančni instrumenti dovolj likvidni za namene izvajanja obveznosti trgovanja za izvedene finančne instrumente.

Člen 2

Vsebina zahtevkov za podatke in informacije, ki se sporočajo

1. Za izračune, ki se izvajajo na vnaprej določene datume ali z vnaprej določeno pogostostjo, mesta trgovanja, APA in CTP svojim pristojnim organom predložijo vse podatke, ki se zahtevajo za izvedbo izračunov, določenih v naslednjih uredbah:

- (a) Delegirana uredba (EU) 2017/587;
- (b) Delegirana uredba (EU) 2017/583;
- (c) Delegirana uredba (EU) 2017/567;
- (d) Delegirana uredba (EU) 2017/565.

2. Pristojni organi lahko po potrebi od mest trgovanja, APA in CTP zahtevajo dodatne informacije za namene spremljanja in prilagajanja pragov in parametrov iz točk (a) do (f) in (h) člena 1.

3. Pristojni organi lahko zahtevajo vse podatke, ki jih mora ESMA upoštevati v skladu z Delegirano uredbno (EU) 2016/2020, vključno s podatki o:

- (a) povprečni pogostosti poslov;
- (b) povprečni velikosti poslov in njihovi porazdelitvi;
- (c) številu in vrsti udeležencev na trgu;
- (d) povprečni velikosti razmikov.

Člen 3

Pogostost zahtevkov za podatke in odzivni čas za mesta trgovanja, APA in CTP

1. Mesta trgovanja, APA in CTP vsak dan predložijo podatke iz člena 2(1).
2. Mesta trgovanja, APA in CTP predložijo podatke v odziv na priložnostni zahtevek iz člena 2(2) v štirih tednih od prejema navedenega zahtevka, razen če izjemne okoliščine zahtevajo odziv v krajšem roku, kot je navedeno v zahtevku.
3. Z odstopanjem od odstavkov 1 in 2 mesta trgovanja in CTP predložijo podatke, ki se uporabljajo za namene mehanizma največjega obsega, kot je določeno v odstavkih 6 do 9 člena 6.

Člen 4

Oblika zahtevkov za podatke

Mesta trgovanja, APA in CTP predložijo podatke iz člena 2 v splošnem formatu XML in, če so na voljo, v skladu s katerimi koli drugimi specifikacijami glede vsebine in oblike, ki so bile določene za olajšanje učinkovitega in avtomatiziranega postopka pošiljanja podatkov ter njihove konsolidacije s podobnimi podatki iz drugih virov.

Člen 5

Vrsta podatkov, ki se morajo hraniti, in minimalno obdobje, v katerem morajo mesta trgovanja, APA in CTP hraniti podatke

1. Mesta trgovanja, APA in CTP hranijo vse podatke, ki se zahtevajo za izračunavanje, spremljanje ali prilagajanje pragov in parametrov iz člena 2, ne glede na to, ali so bile te informacije javno objavljene ali ne.
2. Mesta trgovanja, APA in CTP hranijo podatke iz odstavka 1 vsaj tri leta.

Člen 6

Zahteve glede poročanja za mesta trgovanja in CTP za mehanizem največjega obsega

1. Za vsak finančni instrument, za katerega veljajo zahteve po preglednosti iz člena 3 Uredbe (EU) št. 600/2014, mesta trgovanja pristojnemu organu predložijo naslednje podatke:
 - (a) celotni obseg izvršenega trgovanja s tem finančnim instrumentom na tem mestu trgovanja;
 - (b) celotni obseg poslov, izvršenih s tem finančnim instrumentom na tem mestu trgovanja, na podlagi opustitve iz člena 4(1)(a) ali člena 4(1)(b)(i) Uredbe (EU) št. 600/2014, pri čemer se za vsako vrsto opustitve ločeno sporoči celoten obseg trgovanja.
2. CTP za vsak finančni instrument, za katerega veljajo zahteve po preglednosti iz člena 3 Uredbe (EU) št. 600/2014, in, če tako zahteva pristojni organ, pristojnemu organu predloži naslednje podatke:
 - (a) celotni obseg trgovanja s tem finančnim instrumentom na vseh mestih trgovanja v Uniji, pri čemer ločeno navede celotni obseg za vsako mesto trgovanja;
 - (b) celotni obseg poslov, izvršenih na vseh mestih trgovanja v Uniji, na podlagi opustitve iz člena 4(1)(a) ali člena 4(1)(b)(i) Uredbe (EU) št. 600/2014, pri čemer za vsako vrsto opustitve ločeno sporoči celotni obseg trgovanja.
3. Mesta trgovanja in CTP pristojnemu organu predložijo podatke iz odstavkov 1 in 2 z uporabo preglednic iz Priloge. Zlasti zagotovijo, da so identifikatorji mest trgovanja dovolj natančni, da lahko pristojni organi in ESMA za vsako mesto trgovanja ugotovijo obseg trgovanja, izvršenega na podlagi opustitve pri referenčni ceni, za likvidne finančne instrumente pa na podlagi opustitve pri dogovorjeni ceni, ter omogočajo izračun odstotka, določenega v členu 5(1)(a) Uredbe (EU) št. 600/2014.
4. Za izračun obsega iz odstavkov 1 in 2:
 - (a) se obseg posameznega posla določi s pomnožitvijo cene finančnega instrumenta s številom enot, s katerim se je trgovalo;
 - (b) se celotni obseg trgovanja z vsakim finančnim instrumentom iz odstavka 1(a) in odstavka 2(a) določi z združevanjem obsega vseh posameznih poslov in poslov, izračunanih z enojnim štetjem, za ta finančni instrument;
 - (c) se obseg trgovanja iz odstavka 1(b) in odstavka 2(b) določi z združevanjem obsega posameznih poslov in poslov, izračunanih z enojnim štetjem, za ta finančni instrument, sporočenih pod oznakama „referenčna cena“ in „dogovorjeni posli za likvidnimi finančnimi instrumenti“ v skladu s preglednico 4 Priloge I k Delegirani uredbi (EU) 2017/587.

5. Mesta trgovanja in CTP združijo samo posle, izvedene v isti valuti, in ločeno sporočijo vsak združeni obseg v valuti, uporabljeni pri poslih.
6. Mesta trgovanja pristojnemu organu predložijo podatke iz odstavkov 1 do 5 prvi in šestnajsti dan vsakega koledarskega meseca do 13:00 po srednjeevropskem času. Če je prvi ali šestnajsti dan koledarskega meseca za mesto trgovanja dela prost dan, mesto trgovanja sporoči podatke pristojnemu organu naslednji delovni dan do 13:00 po srednjeevropskem času.
7. Mesta trgovanja pristojnemu organu predložijo podatke o celotnem obsegu trgovanja, določenem v skladu z odstavki 1 do 5, za naslednja obdobja:
- (a) za poročila, ki se predložijo šestnajsti dan vsakega koledarskega meseca, je obdobje izvrševanja od prvega do petnajstega dne istega koledarskega meseca;
 - (b) za poročila, ki se predložijo prvi dan vsakega koledarskega meseca, je obdobje izvrševanja od šestnajstega do zadnjega dne prejšnjega koledarskega meseca.
8. Z odstopanjem od odstavkov 6 in 7 mesta trgovanja predložijo prvo poročilo, razčlenjeno po finančnih instrumentih, na datum začetka uporabe Direktive 2014/65/EU ter Uredbe (EU) št. 600/2014 do 13:00 po srednjeevropskem času, poročila pa vsebujejo podatke o obsegu trgovanja iz člena 1 za prejšnje koledarsko leto. V ta namen mesta trgovanja za vsak koledarski mesec ločeno poročajo o:
- (a) obsegu trgovanja v obdobju od prvega do petnajstega dne vsakega koledarskega meseca;
 - (b) obsegu trgovanja v obdobju od šestnajstega do zadnjega dne vsakega koledarskega meseca.
9. Mesta trgovanja in CTP odgovorijo na vsak priložnostni zahtevek pristojnih organov za podatke o obsegu trgovanja v zvezi z izračuni, ki se izvajajo za spremljanje uporabe opustitev pri referenčni ceni ali dogovorjeni ceni do konca delovnega časa naslednji delovni dan po prejemu zahtevka.

Člen 7

Zahteve za pristojne organe glede poročanja ESMA za namene mehanizma največjega obsega in obveznosti trgovanja z izvedenimi finančnimi instrumenti

1. Pristojni organi ESMA zagotovijo podatke, ki jih v skladu s členom 6 prejmejo od mesta trgovanja ali CTP, naslednji delovni dan po prejemu do 13:00 po srednjeevropskem času.
2. Pristojni organi ESMA zagotovijo podatke, ki jih prejmejo od mesta trgovanja, APA ali CTP za določitev, ali so izvedeni finančni instrumenti dovolj likvidni, kakor je navedeno v členu 1(h), brez nepotrebne odlašanja in najpozneje v treh delovnih dneh po prejemu ustreznih podatkov.

Člen 8

Zahteve za ESMA glede poročanja za namene mehanizma največjega obsega

1. ESMA objavi izmerjene podatke o celotnem obsegu trgovanja za vsak finančni instrument v preteklih 12 mesecih ter odstotke trgovanja na podlagi opustitev pri dogovorjeni ceni in pri referenčni ceni za celotno Unijo ter za vsako mesto trgovanja v preteklih 12 mesecih v skladu z odstavki 4, 5 in 6 člena 5 Uredbe (EU) št. 600/2014 najpozneje peti delovni dan po izteku obdobja poročanja, določenih v členu 6(6) te uredbe, do 22:00 po srednjeevropskem času.
2. Objava iz odstavka 1 je brezplačna ter v berljivi in strojno berljivi obliki, kot je opredeljeno v členu 14 Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/571 ⁽¹⁾ in odstavkih 4 in 5 člena 13 Delegirane uredbe (EU) 2017/567.

⁽¹⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/571 z dne 2. junija 2016 o dopolnitvi Direktive 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o dovoljenju, organizacijskih zahtevah in objavi poslova za izvajalce storitev sporočanja podatkov (glej stran 126 tega Uradnega lista).

3. Če se s finančnim instrumentom trguje v več kot eni valuti v vsej Uniji, ESMA pretvori celoten obseg v eure, pri čemer uporabi povprečni menjalni tečaj, izračunan na podlagi dnevni referenčnih menjalnih tečajev eura, ki jih je na svoji spletni strani objavila Evropska centralna banka v preteklih 12 mesecih. Ta pretvorjen obseg se uporabi za izračun in objavo celotnega obsega trgovanja in odstotke trgovanja na podlagi opustitev pri dogovorjeni ceni in pri referenčni ceni za celotno Unijo ter za vsako mesto trgovanja, kot je navedeno v odstavku 1.

Člen 9

Začetek veljavnosti in uporaba

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Uporablja se od 3. januarja 2018.

Ta uredba je v celoti zavezujoča in se neposredno uporablja v vseh državah članicah.

V Bruslju, 13. junija 2016

Za Komisijo
Predsednik
Jean-Claude JUNCKER

PRILOGA

Razpredelnica 1

Razpredelnica z oznakami za razpredelnico 2

OZNAKA	VRSTA PODATKOV	OPREDELITEV
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričnih znakov	Polje za prosto besedilo
{DECIMAL-n/m}	Decimalno število s skupno do n števkami, od katerih so do m števk lahko decimalke.	Numerično polje za pozitivne in negativne vrednosti. — Decimalno ločilo je „.“ (pika). — Pred številom je lahko „-“ za označitev negativnih števil. Kjer je ustrezno, se vrednosti zaokrožijo in se ne skrajšajo.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerični znaki	Tričrkovna koda valute, kot je opredeljena s kodo valute po ISO 4217.
{DATEFORMAT}	Oblika datuma po ISO 8601	Datumi se poročajo v naslednji obliki: LLLL-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumeričnih znakov	Koda ISIN, kot je opredeljena v standardu ISO 6166.
{MIC}	4 alfanumerični znaki	Identifikator trga, kot je opredeljen v standardu ISO 10383.

Razpredelnica 2

Oblike poročil za namene mehanizma največjega obsega

Naziv podatkovnega polja	Oblika
Obdobje poročanja	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} Prvi datum je začetek obdobja poročanja, drugi pa konec obdobja poročanja.
Identifikacija subjekta, ki poroča	Če je subjekt, ki poroča, mesto trgovanja: {MIC} (MIC segmenta ali, kjer je ustrezno, operativni MIC) ali {ALPHANUM-50}, če je subjekt, ki poroča, CTP.
Identifikator mesta trgovanja	{MIC} (MIC segmenta ali, kjer je na voljo, drugače operativni MIC)
Identifikator instrumenta	{ISIN}
Valuta posla	{CURRENCYCODE_3}
Celotni obseg trgovanja (po valutah)	{DECIMAL-18/5}

Naziv podatkovnega polja	Oblika
Celotni obseg trgovanja na podlagi opustitev pri referenčni ceni, kot je opredeljeno v členu 4(1)(a) MiFIR (po valutah).	{DECIMAL-18/5}
Celotni obseg trgovanja na podlagi opustitev pri dogovorjeni ceni, kot je opredeljeno v členu 4(1)(b)(i) MiFIR (po valutah).	{DECIMAL-18/5}