

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/577**od 13. lipnja 2016.****o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda o mehanizmu najvećeg volumena i pružanju informacija za potrebe transparentnosti i drugih izračuna****(Tekst značajan za EGP)**

EUROPSKA KOMISIJA,

uzimajući u obzir Ugovor o funkcioniranju Europske unije,

uzimajući u obzir Uredbu (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća od 15. svibnja 2014. o tržištima financijskih instrumenata i izmjeni Uredbe (EU) br. 648/2012 ⁽¹⁾, a posebno njezin članak 5. stavak 9. i članak 22. stavak 4.,

budući da:

- (1) U skladu s Uredbom (EU) br. 600/2014 nadležna tijela i Europsko nadzorno tijelo za vrijednosne papire i tržišta kapitala (ESMA) moraju provesti velik broj izračuna kako bi se mogućnost primjene režima transparentnosti prije i poslije trgovanja uskladila s obvezom trgovanja za izvedenice te kako bi se utvrdilo je li određeno investicijsko društvo sistematski internalizator.
- (2) Kako bi mogli provesti potrebne izračune, i nadležna tijela i ESMA moraju imati mogućnost da dođu do pouzdanih i kvalitetnih podataka za svaki razred imovine na koji se primjenjuje Uredba (EU) br. 600/2014. Stoga je nužno poboljšati i dostupnost i kvalitetu podataka koji su na raspolaganju nadležnim tijelima i ESMA-i u skladu s Direktivom 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća ⁽²⁾ i Uredbom (EU) br. 600/2014 kako bi se razvrstavanje financijskih instrumenata u razrede, uključujući pragove u svrhu transparentnosti prije i poslije trgovanja i, prema potrebi, ponovnu prilagodbu tih pragova, mogli izračunati na informiranijoj osnovi nakon određenog vremena primjene režima.
- (3) Trebalo bi utvrditi odredbe kojima bi se u općim crtama definirali zajednički elementi u smislu sadržaja i formata podataka koje mjesta trgovanja, ovlašteni sustavi objavljivanja (APA-e) i pružatelji konsolidiranih podataka o trgovanju (CTP-ovi) moraju dostavljati u svrhu transparentnosti i drugih izračuna. Te bi se odredbe trebale tumačiti zajedno s onima Delegiranih uredbi Komisije (EU) 2017/587 ⁽³⁾, (EU) 2017/583 ⁽⁴⁾, (EU) 2017/567 ⁽⁵⁾, (EU) 2017/565 ⁽⁶⁾ i (EU) 2016/2020 ⁽⁷⁾ u kojima su opisani metodologija i podaci koji su potrebni za provedbu relevantnih izračuna te u kojima su definirani sadržaj i opseg podataka potrebnih za provedbu izračuna

⁽¹⁾ SL L 173, 12.6.2014., str. 84.⁽²⁾ Direktiva 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 15. svibnja 2014. o tržištu financijskih instrumenata i izmjeni Direktive 2002/92/EZ i Direktive 2011/61/EU (SL L 173, 12.6.2014., str. 349.).⁽³⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/587 od 14. srpnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda za zahtjeve o transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u vezi s dionicama, potvrđama o deponiranim vrijednosnim papirima, fondovima čijim se udjelima trguje na burzi, certifikatima i drugim sličnim financijskim instrumentima te za obveze izvršavanja transakcija u pogledu određenih dionica na mjestu trgovanja ili putem sistematskog internalizatora (vidjeti stranicu 387. ovoga Službenog lista).⁽⁴⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/583 od 14. srpnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda u vezi sa zahtjevima u pogledu transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u odnosu na obveznice, strukturirane financijske proizvode, emisijske jedinice i izvedenice (vidjeti stranicu 229. ovoga Službenog lista).⁽⁵⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/567 od 18. svibnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu definicija, transparentnosti, kompresije portfelja te nadzornih mjera za intervenciju u području proizvoda i pozicija (vidjeti stranicu 90. ovoga Službenog lista).⁽⁶⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/565 od 25. travnja 2016. o dopuni Direktive 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća u vezi s organizacijskim zahtjevima i uvjetima poslovanja investicijskih društava te izrazima definiranim za potrebe te Direktive (vidjeti stranicu 1. ovoga Službenog lista).⁽⁷⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2016/2020 od 26. svibnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda o kriterijima za utvrđivanje trebaju li izvedenice koje podliježu obvezi poravnanja podliježati obvezi trgovanja (SL L 313, 19.11.2016., str. 2.).

povezanih s transparentnošću. Stoga bi sadržaj, format i kvaliteta podataka dostavljenih u vezi s mjestima trgovanja, APA-ma i CTP-ovima trebali biti u skladu s primjenjivom metodologijom koja je na temelju relevantnih provedbenih akata Direktive 2014/65/EU i Uredbe (EU) br. 600/2014 propisana za provedbu tih izračuna.

- (4) Uz iznimku potencijalnih *ad hoc* zahtjeva za dostavljanje podataka i izračuna koje treba provesti za potrebe mehanizma najvećeg volumena, mjesta trgovanja, ovlašteni sustavi objavljivanja i pružatelji konsolidiranih podataka o trgovanju trebali bi podnositi dnevna izvješća. S obzirom na široku paletu financijskih instrumenata na koje se to odnosi i veliku količinu podataka koji se moraju obraditi, ta dnevna izvješća nadležnim tijelima omogućuju precizniju obradu dosjea razumnih dimenzija i osiguravaju učinkovito i pravovremeno upravljanje dostavljanjem podataka, provjerom njihove kvalitete i njihovom obradom. Svakodnevno prikupljanje podataka pojednostavnjuje i obvezu dostavljanja podataka za mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ove smanjujući opterećenje koje im predstavlja izračun broja dana trgovanja u slučajevima u kojima se primjenjuje kvantitativni kriterij likvidnosti te objedinjavanje podataka za isti financijski instrument u različitim razdobljima dospijeca ako je potrebno uzeti u obzir vrijeme preostalo do dospijeca. Centralizacijom tog izračuna osigurava se i dosljedna primjena kriterija na sve financijske instrumente i mjesta trgovanja.
- (5) Mjesta trgovanja trebala bi pohranjivati podatke koji su sveobuhvatni te koji nadležnim tijelima i ESMA-i omogućuju provedbu točnih izračuna. Iako se potrebne informacije obično dostavljaju u izvješćima poslije trgovanja, u nekim slučajevima informacije potrebne za izračune nisu sadržane u navedenim izvješćima. Na primjer, to mogu biti informacije o transakcijama koje se izvršavaju na temelju naloga za koje vrijedi izuzeće za veliki tržišni obujam. Te informacije ne bi trebale biti uključene u izvješća o trgovanju jer bi na taj način takve transakcije bile izložene štetnom tržišnom utjecaju. Međutim, budući da bi te informacije mogle biti potrebne nadležnim tijelima za izvođenje točnih izračuna, mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi trebali bi ih pohranjivati na primjeren način i prema potrebi dostavljati nadležnim tijelima i ESMA-i. Mjesta trgovanja trebala bi osigurati da na primjeren način šire informacije koje moraju dostaviti nadležnim tijelima i ESMA-i. Transakcije izvršene na temelju velikih naloga trebale bi biti primjereno označene u izvješćima namijenjenima CTP-ovima.
- (6) Podatke bi trebalo prikupljati iz raznih izvora zato što jedan izvor ne mora uvijek raspolagati čitavim skupom podataka za određeni razred imovine ili čak za pojedinačni instrument. Stoga bi se mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi radi lakšeg i troškovno učinkovitijeg prikupljanja podataka trebali koristiti unaprijed određenim specifikacijama u smislu sadržaja i formata, ako su dostupne, kako bi nadležnim tijelima i ESMA-i omogućili da dobivaju i konsolidiraju kvalitetne podatke iz različitih izvora.
- (7) S obzirom na osjetljivost potrebnih izračuna i potencijalnih gospodarskih posljedica objave netočnih informacija za mjesta trgovanja, izdavatelje i druge sudionike na tržištu, što bi u slučaju mehanizma najvećeg volumena moglo dovesti do suspenzije uporabe izuzeća za određeno mjesto trgovanja ili u cijeloj Uniji za određeni financijski instrument, ključno je jasno odrediti format u kojem se podaci trebaju dostavljati nadležnim tijelima i ESMA-i kako bi se uspostavili učinkoviti kanali komunikacije s mjestima trgovanja i CTP-ovima i osigurala pravovremena i pravilna objava zatraženih podataka.
- (8) U skladu s Uredbom (EU) br. 600/2014 ESMA za financijske instrumente na koje se primjenjuje mehanizam najvećeg volumena mora objavljivati podatke o izmjenom ukupnom volumenu trgovanja u prethodnih 12 mjeseci i postotcima trgovanja na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama i izuzeća u vezi s referentnom cijenom za cijelu Uniju i za svako mjesto trgovanja u prethodnih 12 mjeseci. U slučaju financijskih instrumenata kojima se trguje u više od jedne valute potrebno je volumene trgovanja izvršenog u različitim valutama pretvoriti u jednu zajedničku valutu kako bi se omogućio izračun tih volumena i proveli potrebni izračuni. Stoga bi trebalo predvidjeti metodologiju i devizne tečajeve koji će se, prema potrebi, koristiti za pretvaranje volumenâ trgovanja.
- (9) Za potrebe mehanizma najvećeg volumena, trebalo bi od mjesta trgovanja zahtijevati da izvještavaju o volumenima trgovanja izvršenog na temelju izuzeća u vezi s referentnom cijenom i, u slučaju likvidnih instrumenata, na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama. S obzirom na to da se izuzeća primjenjuju na naloge, a ne na transakcije, važno je pojasniti da bi volumen, o kojima je potrebno izvijestiti, trebali obuhvaćati sve transakcije označene s „RFPT” ili „NLIQ” za potrebe objavljivanja transakcija poslije trgovanja i kako je određeno u Delegiranoj uredbi (EU) 2017/587. Ako je transakcija izvršena na temelju dva naloga za koje vrijedi izuzeće za veliki tržišni obujam, ta transakcija ne bi trebala ulaziti u izračun volumena izračunanih na temelju izuzeća u vezi s referentnom cijenom i izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama.
- (10) Za potrebe mehanizma najvećeg volumena, mjesta trgovanja i CTP-ovi trebali bi osigurati da je mjesto trgovanja na kojem je transakcija izvršena identificirano dovoljno precizno kako bi ESMA mogla provesti sve izračune iz Uredbe (EU) br. 600/2014. Osobito bi se za svako mjesto trgovanja trebao upotrebljavati jedinstveni identifikator

koji se ne bi smio upotrebljavati ni za jedno drugo mjesto trgovanja kojim upravlja isti tržišni operator. Na temelju identifikatora mjesta trgovanja ESMA bi trebala moći na nedvosmislen način identificirati sva mjesta trgovanja za koja je tržišni operator dobio posebno odobrenje u skladu s Direktivom 2014/65/EU.

- (11) U svrhu mehanizma najvećeg volumena, od mjesta trgovanja potrebno je zahtijevati da prvo izvješće, koje sadržava volumen trgovanja na temelju izuzeća u vezi s referentnom cijenom i, za likvidne financijske instrumente, izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama za prethodnu kalendarsku godinu, dostave na dan početka primjene Direktive 2014/65/EU i Uredbe (EU) br. 600/2014. Kako bi se osigurala razmjerna primjena tog zahtjeva, mjesta trgovanja bi u tu svrhu trebala izrađivati svoja izvješća na temelju prilagođenog volumena trgovanja izvršenog na temelju jednakovrijednih izuzeća utvrđenih u Direktivi 2004/39/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾ i Uredbi Komisije (EZ) br. 1287/2006 ⁽²⁾.
- (12) Kako bi nadležna tijela i ESMA dobili točne podatke, mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi trebali bi osigurati da njihova izvješća sadržavaju isključivo samo jednom knjižene transakcije.
- (13) Odredbe u ovoj uredbi usko su međusobno povezane jer se njima propisuje sadržaj, učestalost i format zahtjeva za dostavljanje podataka, metoda obrade tih podataka i druge specifikacije koje se odnose na objavljivanje informacija u svrhu transparentnosti kako je definirano u Uredbi (EU) br. 600/2014. Kako bi se osigurala dosljednost tih odredaba, koje će stupiti na snagu istodobno, te kako bi se dionicima, a posebno onima koji podliježu tim obvezama, omogućio sveobuhvatan pregled, poželjno je da ih se sve uključi u istu uredbu.
- (14) Radi dosljednosti i kako bi se osiguralo nesmetano funkcioniranje financijskih tržišta, potrebno je da se odredbe ove uredbe i odredbe Uredbe (EU) br. 600/2014 primjenjuju od istog datuma.
- (15) Ova se uredba temelji na nacrtu regulatornih tehničkih standarda koji je ESMA dostavila Komisiji.
- (16) ESMA je provela otvorena javna savjetovanja o nacrtu regulatornih tehničkih standarda na kojem se temelji ova uredba, analizirala je moguće povezane troškove i koristi te zatražila mišljenje Interesne skupine za vrijednosne papire i tržišta kapitala osnovane člankom 37. Uredbe (EU) br. 1095/2010 Europskog parlamenta i Vijeća ⁽³⁾,

DONIJELA JE OVU UREDBU:

Članak 1.

Predmet i područje primjene

1. Ovom se uredbom utvrđuju detalji u pogledu zahtjeva za dostavljanje podataka koje upućuju nadležna tijela i detalji u pogledu odgovora na te zahtjeve koje šalju mjesta trgovanja, ovlašteni sustavi objavljivanja (APA-e) i pružatelji konsolidiranih podataka o trgovanju (CTP-ovi) u svrhu izračunavanja i prilagodbe režima transparentnosti prije i poslije trgovanja i obveze trgovanja, a posebno za potrebe određivanja sljedećeg:

- (a) imaju li vlasnički financijski instrumenti, financijski instrumenti poput vlasničkih i nevlasničkih financijski instrumenti likvidno tržište;
- (b) pragova za izuzeća u pogledu transparentnosti prije trgovanja za vlasničke financijske instrumente, financijske instrumente poput vlasničkih i nevlasničke financijske instrumente;

⁽¹⁾ Direktiva 2004/39/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 21. travnja 2004. o tržištima financijskih instrumenata te o izmjeni direktiva Vijeća 85/611/EEZ i 93/6/EEZ i Direktive 2000/12/EZ Europskog parlamenta i Vijeća te stavljanju izvan snage Direktive Vijeća 93/22/EEZ (SL L 145, 30.4.2004., str. 1.).

⁽²⁾ Uredba Komisije (EZ) br. 1287/2006 od 10. kolovoza 2006. o provedbi Direktive 2004/39/EZ Europskog parlamenta i Vijeća u vezi s obvezom vođenja evidencija investicijskih društava, izvještavanjem o transakcijama, transparentnosti tržišta, uvrštavanjem financijskih instrumenata za trgovanje i određenim pojmovima za potrebe navedene Direktive (SL L 241, 2.9.2006., str. 1.).

⁽³⁾ Uredba (EU) br. 1095/2010 Europskog parlamenta i Vijeća od 24. studenoga 2010. o osnivanju europskog nadzornog tijela (Europskog nadzornog tijela za vrijednosne papire i tržišta kapitala), izmjeni Odluke br. 716/2009/EZ i stavljanju izvan snage Odluke Komisije 2009/77/EZ (SL L 331, 15.12.2010., str. 84.).

- (c) pragova za odgode u pogledu transparentnosti poslije trgovanja za vlasničke financijske instrumente, financijske instrumente poput vlasničkih i nevlasničke financijske instrumente;
- (d) trenutka u kojem likvidnost razreda financijskih instrumenata padne ispod određenog praga;
- (e) je li investicijsko društvo sistematski internalizator;
- (f) standardne veličine tržišta primjenjive na sistematske internalizatore koji trguju vlasničkim instrumentima i instrumentima poput vlasničkih te veličine specifične za instrument primjenjive na sistematske internalizatore koji trguju nevlasničkim instrumentima;
- (g) za vlasničke instrumente i instrumente poput vlasničkih, ukupnog volumena trgovanja u prethodnih 12 mjeseci i postotaka trgovanja ostvarenog na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama i izuzeća u vezi s referentnom cijenom za cijelu Uniju i za svako mjesto trgovanja u prethodnih 12 mjeseci;
- (h) jesu li izvedenice dovoljno likvidne za provedbu obveze trgovanja za izvedenice.

Članak 2.

Sadržaj zahtjeva za dostavljanje podataka i informacija koji podliježu obvezi izvješćivanja

1. Kako bi se omogućili izračuni koji se provode na unaprijed određene datume i unaprijed određenom učestalosti, mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi svojim nadležnim tijelima dostavljaju sve podatke potrebne za provedbu izračuna iz sljedećih uredbi:

- (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. Nadležna tijela mogu, prema potrebi, od mjesta trgovanja, APA-a i CTP-ova zatražiti dodatne informacije u svrhu praćenja i prilagodbe pragova i parametara iz članka 1. točaka od (a) do (f) i točke (h).

3. Nadležna tijela mogu zatražiti sve podatke koje je ESMA dužna uzeti u obzir u skladu s Delegiranom uredbom (EU) 2016/2020 za nevlasničke financijske instrumente, uključujući podatke o sljedećem:

- (a) prosječnoj učestalosti trgovanja;
- (b) prosječnom opsegu i distribuciji trgovanja;
- (c) broju i vrsti sudionika na tržištu;
- (d) prosječnoj veličini raspona cijena.

Članak 3.

Učestalost zahtjeva za dostavljanje podataka i rokovi za odgovor za mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ove

1. Mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi svakodnevno dostavljaju podatke iz članka 2. stavka 1.

2. U slučaju *ad hoc* zahtjeva, mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi dostavljaju podatke iz članka 2. stavka 2. u roku od četiri tjedna od primitka zahtjeva osim ako je zbog iznimnih okolnosti, navedenih u samom zahtjevu, potreban odgovor u kraćem roku. Imaju i DE čini mi se kao IT, stavi tako.

3. Odstupajući od stavaka 1. i 2., mjesta trgovanja i CTP-ovi dostavljaju podatke koji se koriste za potrebe mehanizma najvećeg volumena kako je navedeno u članku 6. stavcima 6. do 9.

Članak 4.

Format zahtjeva za dostavljanje podataka

Mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi dostavljaju podatke iz članka 2. u zajedničkom XML formatu i, ako je moguće, u skladu sa svim drugim specifikacijama u pogledu sadržaja i formata kako bi se omogućio učinkovit i automatiziran proces dostave podataka te njihove konsolidacije sa sličnim podacima iz drugih izvora.

Članak 5.

Vrsta podataka koji se moraju pohraniti i minimalno razdoblje na koje mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi moraju pohraniti podatke

1. Mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi pohranjuju sve podatke potrebne za izračunavanje, praćenje i prilagodbu pragova i parametara iz članka 2. neovisno o tome jesu li informacije objavljene ili ne.
2. Mjesta trgovanja, APA-e i CTP-ovi pohranjuju podatke iz stavka 1. na najmanje tri godine.

Članak 6.

Zahtjevi za izvješćivanje za mjesta trgovanja i CTP-ove za potrebe mehanizma najvećeg volumena

1. Za svaki financijski instrument koji podliježe zahtjevima o transparentnosti iz članka 3. Uredbe (EU) br. 600/2014, mjesta trgovanja nadležnom tijelu dostavljaju sljedeće podatke:
 - (a) ukupan volumen trgovanja financijskim instrumentom koje je izvršeno na tom mjestu trgovanja;
 - (b) ukupan volumen trgovanja financijskim instrumentom koje je izvršeno na tom mjestu trgovanja na koje se primjenjuju izuzeća iz članka 4. stavka 1. točke (a) odnosno članka 4. stavka 1. točke (b) podtočke i. Uredbe (EU) br. 600/2014, pri čemu se ukupni volumen navodi zasebno za svako izuzeće.
2. Za svaki financijski instrument koji podliježe zahtjevima o transparentnosti iz članka 3. Uredbe (EU) br. 600/2014 i kada to zahtijeva nadležno tijelo, CTP-ovi nadležnom tijelu dostavljaju sljedeće podatke:
 - (a) ukupni volumen trgovanja financijskim instrumentom koje je izvršeno na svim mjestima trgovanja u Uniji, pri čemu se ukupni volumen za svako mjesto trgovanja navodi zasebno;
 - (b) ukupni volumen trgovanja koje je izvršeno na svim mjestima trgovanja u Uniji na koje se primjenjuju izuzeća iz članka 4. stavka 1. točke (a) odnosno članka 4. stavka 1. točke (b) podtočke i. Uredbe (EU) br. 600/2014, pri čemu se ukupni volumen za svako izuzeće i za svako mjesto trgovanja navodi zasebno.
3. Mjesta trgovanja i CTP-ovi nadležnom tijelu dostavljaju podatke iz stavaka 1. i 2. koristeći se formatima iz Priloga. Oni posebice moraju osigurati da su identifikatori mjesta trgovanja koje dostavljaju dovoljno precizno definirani kako bi nadležno tijelo i ESMA mogli za svako mjesto trgovanja utvrditi volumen trgovanja koje je izvršeno na temelju izuzeća u vezi s referentnom cijenom i, za likvidne financijske instrumente, na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama i omogućiti izračun udjela iz članka 5. stavka 1. točke (a) Uredbe (EU) br. 600/2014.
4. Za izračunavanje volumena iz stavaka 1. i 2.:
 - (a) volumen pojedinačne transakcije dobiva se tako da se cijena financijskog instrumenta pomnoži s brojem jedinica kojima se trgovalo;
 - (b) ukupni volumen trgovanja svakim financijskim instrumentom iz stavka 1. točke (a) i stavka 2. točke (a) dobiva se zbrajanjem volumena svih pojedinačnih i samo jednom knjiženih transakcija za taj financijski instrument.
 - (c) volumen trgovanja iz stavka 1. točke (b) i stavka 2. točke (b) izračunava se zbrajanjem volumena pojedinačnih i samo jednom knjiženih transakcija za taj financijski instrument prijavljenih pod oznakama „referentna cijena” i „dogovorene transakcije u likvidnim financijskim instrumentima” u skladu s tablicom 4. Priloga I. Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/587.

5. Mjesta trgovanja i CTP-ovi zbrajaju samo transakcije izvršene u istoj valuti i zasebno dostavljaju svaki zbrojeni volumen u valuti korištenoj za transakcije.
6. Mjesta trgovanja nadležnom tijelu dostavljaju podatke iz stavaka 1. do 5. prvog i šesnaestog dana svakog kalendarskog mjeseca do 13:00 h po srednjoeuropskom vremenu. Ako je za mjesto trgovanja prvi ili šesnaesti dan kalendarskog mjeseca neradni dan, mjesto trgovanja nadležnom tijelu dostavlja podatke sljedećeg radnog dana do 13:00 h po srednjoeuropskom vremenu.
7. Mjesta trgovanja nadležnom tijelu dostavljaju podatke o ukupnom volumenu trgovanja utvrđenom u skladu sa stavcima 1. do 5. za sljedeća razdoblja:
- (a) za izvješća koja se dostavljaju šesnaestog dana svakog kalendarskog mjeseca razdoblje izvršenja je od prvog do petnaestog dana istog kalendarskog mjeseca;
 - (b) za izvješća koja se dostavljaju prvog dana svakog kalendarskog mjeseca razdoblje izvršenja je od šesnaestog do zadnjeg dana prethodnog kalendarskog mjeseca.
8. Odstupajući od stavaka 6. i 7., mjesta trgovanja dostavljaju prvo izvješće po financijskom instrumentu na dan početka primjene Direktive 2014/65/EU i Uredbe (EU) br. 600/2014 do 13:00 h po srednjoeuropskom vremenu te uključuju volumen trgovanja iz stavka 1. za prethodnu kalendarsku godinu. U tu svrhu mjesta trgovanja za svaki kalendarski mjesec zasebno izvještavaju o sljedećem:
- (a) volumenu trgovanja u razdoblju od prvog do petnaestog dana svakog kalendarskog mjeseca;
 - (b) volumenu trgovanja u razdoblju od šesnaestog do zadnjeg dana svakog kalendarskog mjeseca.
9. Mjesta trgovanja i CTP-ovi na svaki *ad hoc* zahtjev nadležnih tijela o volumenu trgovanja u vezi s izračunima koji se provode radi praćenja primjene izuzeća u vezi s referentnom cijenom ili izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama odgovaraju do kraja radnog vremena u radnom danu nakon dana primitka zahtjeva.

Članak 7.

Zahtjevi za nadležna tijela u pogledu izvješćivanja ESMA-e za potrebe mehanizma najvećeg volumena i obveze trgovanja za izvedenice

1. Nadležna tijela ESMA-i dostavljaju podatke koje su primila od mjesta trgovanja ili CTP-a u skladu s člankom 6. sljedećeg radnog dana od njihova primitka do 13:00 h po srednjoeuropskom vremenu.
2. Nadležna tijela ESMA-i dostavljaju podatke koje su primila od mjesta trgovanja, APA-e ili CTP-a radi utvrđivanja jesu li izvedenice dovoljno likvidne kako je navedeno u članku 1. točki (h), bez neopravdanog kašnjenja i najkasnije tri radna od primitka relevantnih podataka.

Članak 8.

Zahtjevi za izvješćivanje za ESMA-u za potrebe mehanizma najvećeg volumena

1. ESMA objavljuje podatke o izmjerenom ukupnom volumenu trgovanja za svaki financijski instrument u prethodnih 12 mjeseci i postotcima trgovanja na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama i izuzeća u vezi s referentnom cijenom za cijelu Uniju i za svako mjesto trgovanja u prethodnih 12 mjeseci, u skladu s člankom 5. stavcima 4., 5. i 6. Uredbe (EU) br. 600/2014, najkasnije u 22:00 h po srednjoeuropskom vremenu petog radnog dana nakon isteka razdoblja izvješćivanja iz članka 6. stavka 6. ove uredbe.
2. Objava iz stavka 1. besplatna je te je u strojno čitljivom formatu i u formatu koji je čitljiv ljudima kako je definirano u članku 14. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/571 ⁽¹⁾ i u članku 13. stavcima 4. i 5. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/567.

⁽¹⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/571 od 2. lipnja 2016. o dopuni Direktive 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za izdavanje odobrenja za rad, organizacijske zahtjeve i objavljivanje transakcija za pružatelje usluga dostave podataka (vidjeti stranicu 126. ovoga Službenog lista).

3. Ako se financijskim instrumentom trguje u više od jedne valute u cijeloj Uniji, ESMA sve volumene pretvara u euro pri čemu koristi prosječne tečajeve izračunane na temelju dnevnih referentnih deviznih tečajeva eura koje je Europska središnja banka objavila na svojem *web*-mjestu u prethodnih 12 mjeseci. Taj pretvoreni volumen koristi se za izračunavanje i objavu ukupnog volumena trgovanja i postotaka trgovanja na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama i izuzeća u vezi s referentnom cijenom za cijelu Uniju i za svako mjesto trgovanja kako je navedeno u stavku 1.

Članak 9.

Stupanje na snagu i primjena

Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Primjenjuje se od 3. siječnja 2018.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i izravno se primjenjuje u svim državama članicama.

Sastavljeno u Bruxellesu 13. lipnja 2016.

Za Komisiju
Predsjednik
Jean-Claude JUNKER

PRILOG

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2.

OZNAKA	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimala	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. — decimalni razdjelnik je „.” (točka); — pred broj je moguće staviti „-” (minus) za označavanje negativnih brojeva. Vrijednosti se, prema potrebi, zaokružuju, a ne skraćuju.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerička znaka	Troslovni kod države, kako je definirano u valutnim oznakama u skladu s normom ISO 4217
{DATEFORMAT}	Format datuma u skladu s normom ISO 8601	Datumi bi se trebali navoditi u sljedećem formatu: GGGG-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumeričkih znakova	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383

Tablica 2.

Formati izvješća za potrebe mehanizma najvećeg volumena

Naziv podatkovnog polja	Format
Razdoblje izvješćivanja	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} pri čemu je prvi datum početak razdoblja izvješćivanja, a drugi kraj razdoblja izvješćivanja.
Identifikacija subjekta koji podnosi izvješće	Ako je subjekt koji podnosi izvješće mjesto trgovanja: {MIC} (MIC segmenta ili, ako je primjereno, operativni MIC) ili {ALPHANUM-50} ako je subjekt koji podnosi izvješće CTP.
Identifikator mjesta trgovanja	{MIC} (MIC segmenta ako je dostupan, u suprotnome operativni MIC)
Identifikator instrumenta	{ISIN}
Valuta transakcije	{CURRENCYCODE_3}
Ukupan volumen trgovanja (po valuti)	{DECIMAL-18/5}

Naziv podatkovnog polja	Format
Ukupan volumen trgovanja na temelju izuzeća u vezi s referentnom cijenom u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom (a) MiFIR-a (po valuti)	{DECIMAL-18/5}
Ukupan volumen trgovanja na temelju izuzeća u vezi s dogovorenim transakcijama u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom (b) podtočkom i. MiFIR-a (po valuti)	{DECIMAL-18/5}