

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2017/577 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

της 13ης Ιουνίου 2016

για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τον μηχανισμό μέγιστου ορίου συναλλαγών και την παροχή πληροφοριών για τους σκοπούς της διαφάνειας και άλλους υπολογισμούς

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

Η ΕΥΡΩΠΑΪΚΗ ΕΠΙΤΡΟΠΗ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 15ης Μαΐου 2014, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 ⁽¹⁾, και ιδίως το άρθρο 5 παράγραφος 9 και το άρθρο 22 παράγραφος 4,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 600/2014 ορίζει ότι οι αρμόδιες αρχές και η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ΕΑΚΑΑ) πρέπει να πραγματοποιούν σημαντικό αριθμό υπολογισμών, προκειμένου να βαθμονομούν την εφαρμογή του καθεστώτος προσυναλλακτικής και μετασυναλλακτικής διαφάνειας και την υποχρέωση διαπραγμάτευσης για τα παράγωγα, καθώς και να προσδιορίζουν αν μια επιχείρηση επενδύσεων είναι συστηματικός εσωτερικοποιητής.
- (2) Για την πραγματοποίηση των αναγκαίων υπολογισμών, τόσο οι αρμόδιες αρχές όσο και η ΕΑΚΑΑ χρειάζεται να μπορούν να λάβουν αξιόπιστα και υψηλής ποιότητας δεδομένα για κάθε κατηγορία στοιχείων ενεργητικού για την οποία εφαρμόζεται ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 600/2014. Είναι, επομένως, αναγκαίο να βελτιωθούν η προσβασιμότητα και η ποιότητα των δεδομένων τα οποία έχουν στη διάθεσή τους οι αρμόδιες αρχές και η ΕΑΚΑΑ, σύμφωνα με την οδηγία 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽²⁾ και τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014, ώστε η ταξινόμηση των χρηματοπιστωτικών μέσων, συμπεριλαμβανομένων των ορίων για σκοπούς προσυναλλακτικής και μετασυναλλακτικής διαφάνειας και, εφόσον είναι αναγκαίο, των αναβαθμονομήσεων αυτών των ορίων, να μπορεί να υπολογιστεί σε πιο ενημερωμένη βάση, μετά την εφαρμογή του καθεστώτος για ορισμένη χρονική περίοδο.
- (3) Θα πρέπει να θεσπιστούν διατάξεις οι οποίες να προσδιορίζουν γενικά τα κοινά στοιχεία όσον αφορά το περιεχόμενο και τη μορφή των δεδομένων που πρέπει να υποβάλλονται από τόπους διαπραγμάτευσης, εγκεκριμένους μηχανισμούς δημοσιοποίησης συναλλαγών» (Ε.ΜΗ.ΔΗ.ΣΥ)] και παρόχους ενοποιημένων δελτίων (ΠΕΔ) [στην οδηγία: «παρόχους ενοποιημένου δελτίου συναλλαγών» (Π.Ε.ΔΕ.ΣΥ.)], για τους σκοπούς της διαφάνειας και άλλους υπολογισμούς. Αυτές οι διατάξεις θα πρέπει να αναγνωστούν σε συνάρτηση με τους κατ' εξουσιοδότηση κανονισμούς της Επιτροπής (ΕΕ) 2017/587 ⁽³⁾, (ΕΕ) 2017/583 ⁽⁴⁾, (ΕΕ) 2017/567 ⁽⁵⁾, (ΕΕ) 2017/565 ⁽⁶⁾ και (ΕΕ) 2016/2020 ⁽⁷⁾, οι οποίοι περιγράφουν τη μεθοδολογία και τα δεδομένα που είναι αναγκαία για την πραγματοποίηση των σχετικών υπολογισμών και προσδιορίζουν το περιεχόμενο και το εύρος των δεδομένων που είναι αναγκαία για την πραγματοποίηση των υπολογισμών διαφάνειας. Επομένως, κατά την πραγματοποίηση αυτών των υπολογισμών, το περιεχόμενο, η μορφή και η ποιότητα των δεδομένων που υποβάλλονται σχετικά με τόπους

⁽¹⁾ ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 84.⁽²⁾ Οδηγία 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 15ης Μαΐου 2014, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και την τροποποίηση της οδηγίας 2002/92/ΕΚ και της οδηγίας 2011/61/ΕΕ (ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 349).⁽³⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/587 της Επιτροπής, της 14 Ιουλίου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις απαιτήσεις διαφάνειας για τους τόπους διαπραγμάτευσης και τις επιχειρήσεις επενδύσεων ως προς τις μετοχές, τα πιστοποιητικά αποθετηρίου, τα διαπραγματεύσιμα αμοιβαία κεφάλαια, τα πιστοποιητικά και άλλα παρόμοια χρηματοπιστωτικά μέσα και τις υποχρεώσεις εκτέλεσης συναλλαγών σχετικά με ορισμένες μετοχές σε τόπο διαπραγμάτευσης ή από συστηματικό εσωτερικοποιητή (βλέπε σ. 387 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).⁽⁴⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός της Επιτροπής (ΕΕ) 2017/583, της 14ης Ιουλίου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις απαιτήσεις διαφάνειας για τους τόπους διαπραγμάτευσης και τις επιχειρήσεις επενδύσεων ως προς τις ομολογίες, τα δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, τα δικαιώματα εκπομπής και τα παράγωγα (βλέπε σ. 229 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).⁽⁵⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός της Επιτροπής (ΕΕ) 2017/567, της 18ης Μαΐου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2016 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά τους ορισμούς, τη διαφάνεια, τα παράγωγα, τη συμπίεση χαρτοφυλακίου και τα εποπτικά μέτρα σχετικά με παρεμβάσεις σε προϊόντα και θέσεις (βλέπε σ. 90 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).⁽⁶⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός της Επιτροπής (ΕΕ) 2017/565, της 25ης Απριλίου 2016, για τη συμπλήρωση της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, όσον αφορά τις οργανωτικές απαιτήσεις και τους όρους λειτουργίας των επιχειρήσεων επενδύσεων, καθώς και τους ορισμούς που ισχύουν για τους σκοπούς της εν λόγω οδηγίας (βλέπε σ. 1 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).⁽⁷⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2016/2020 της Επιτροπής, της 26ης Μαΐου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά τα ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα σχετικά με τα κριτήρια για τη διαπίστωση κατά πόσον τα παράγωγα που υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης πρέπει να υπόκεινται στην υποχρέωση διαπραγμάτευσης (ΕΕ L 313 της 19.11.2016, σ. 2).

διαπραγμάτευσης, ΕΜΔ και ΠΕΔ θα πρέπει να συνάδουν με την εφαρμοστέα μεθοδολογία που ορίζεται στις συναφείς εκτελεστικές πράξεις της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.

- (4) Με την εξαίρεση ενδεχόμενων αιτημάτων ad hoc για παροχή δεδομένων και υπολογισμών που πρέπει να πραγματοποιούνται για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ θα πρέπει να υποβάλλουν αανφορές καθημερινά. Έχοντας υπόψη το μεγάλο εύρος χρηματοπιστωτικών μέσων που καλύπτονται και τον μεγάλο όγκο δεδομένων που πρέπει να υποστούν επεξεργασία, αυτή η καθημερινή υποβολή επιτρέπει στις αρμόδιες αρχές να επεξεργάζονται με μεγαλύτερη ακρίβεια φακέλους διαχειρίσιμου μεγέθους και διασφαλίζει την αποδοτική και έγκαιρη διαχείριση της υποβολής των δεδομένων, του ελέγχου της ποιότητας και της επεξεργασίας των δεδομένων. Η συγκέντρωση δεδομένων σε καθημερινή βάση απλοποιεί επίσης την υποχρέωση παροχής δεδομένων από τόπους διαπραγμάτευσης, ΕΜΔ και ΠΕΔ, καθώς τους απαλλάσσει από το βάρος να υπολογίζουν τον αριθμό των ημερών διαπραγμάτευσης, στην περίπτωση που εφαρμόζεται το συγκεκριμένο ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας, και να αθροίζουν τα δεδομένα για το ίδιο χρηματοπιστωτικό μέσο με διαφορετικές περιόδους ληκτότητας, στην περίπτωση που πρέπει να λαμβάνεται υπόψη η ληκτότητα. Η πραγματοποίηση αυτού του υπολογισμού σε κεντρικό επίπεδο διασφαλίζει επίσης τη συνεκτική χρήση των κριτηρίων μεταξύ των διαφόρων χρηματοπιστωτικών μέσων και των διαφόρων τύπων διαπραγμάτευσης.
- (5) Οι τόποι διαπραγμάτευσης θα πρέπει να αποθηκεύουν δεδομένα τα οποία είναι περιεκτικά και επιτρέπουν στις αρμόδιες αρχές και στην ΕΑΚΑΑ να πραγματοποιούν ακριβείς υπολογισμούς. Παρόλο που οι απαιτούμενες πληροφορίες παρέχονται συνήθως στις μετασυναλλακτικές γνωστοποιήσεις, σε ορισμένες περιπτώσεις, οι πληροφορίες που είναι αναγκαίες για τους υπολογισμούς υπερβαίνουν τις πληροφορίες που είναι διαθέσιμες σε αυτές τις γνωστοποιήσεις. Σε αυτές περιλαμβάνονται, για παράδειγμα, πληροφορίες για συναλλαγές που έχουν εκτελεστεί βάσει εντολών που έχουν επωφεληθεί από τη μεγάλη μεγέθους απαλλαγή. Αυτές οι πληροφορίες δεν θα πρέπει να περιλαμβάνονται σε γνωστοποιήσεις συναλλαγών, καθώς οι εν λόγω συναλλαγές θα μπορούσαν να εκτεθούν σε δυσμενείς επιπτώσεις στην αγορά. Ωστόσο, δεδομένου ότι αυτές οι πληροφορίες μπορεί να είναι αναγκαίες για τη διενέργεια ακριβών υπολογισμών από τις αρμόδιες αρχές, θα πρέπει να αποθηκεύονται καταλλήλως από τους τόπους διαπραγμάτευσης, τους ΕΜΔ και τους ΠΕΔ και να κοινοποιούνται στις αρμόδιες αρχές και στην ΕΑΚΑΑ, εφόσον είναι αναγκαίο. Οι τόποι διαπραγμάτευσης θα πρέπει να διασφαλίζουν ότι διαδίδουν επαρκώς τις πληροφορίες που πρέπει να παρέχονται στις αρμόδιες αρχές και στην ΕΑΚΑΑ. Οι συναλλαγές που εκτελούνται με βάση εντολές μεγάλου μεγέθους θα πρέπει να προσδιορίζονται καταλλήλως στη γνωστοποίηση προς τους ΠΕΔ.
- (6) Θα πρέπει να συγκεντρώνονται δεδομένα από διάφορες πηγές, καθώς μια μεμονωμένη πηγή μπορεί να μην διαθέτει πάντοτε πλήρες σύνολο δεδομένων για μια κατηγορία στοιχείων ενεργητικού ή ακόμα και για ένα συγκεκριμένο μέσο. Επομένως, για να είναι σε θέση οι αρμόδιες αρχές και η ΕΑΚΑΑ να λαμβάνουν και να ενοποιούν δεδομένα υψηλής ποιότητας από διάφορες πηγές, οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ θα πρέπει να χρησιμοποιούν, εφόσον υπάρχουν διαθέσιμες, προκαθορισμένες προδιαγραφές όσον αφορά το περιεχόμενο και τη μορφή, ώστε η συγκέντρωση των δεδομένων να είναι ευκολότερη και περισσότερο αποδοτική ως προς το κόστος της.
- (7) Λαμβάνοντας υπόψη την ευαισθησία των αναγκαίων υπολογισμών και τις δυνητικές εμπορικές συνέπειες για τους τόπους διαπραγμάτευσης, τους εκδότες και άλλους συμμετέχοντες στην αγορά, λόγω της δημοσίευσης εσφαλμένων πληροφοριών, η οποία θα μπορούσε να οδηγήσει, στην περίπτωση μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, στην αναστολή της χρήσης των απαλλαγών για έναν συγκεκριμένο τόπο συναλλαγών ή σε ολόκληρη την Ένωση για ένα συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο, είναι εξαιρετικά σημαντικό να διασαφηνιστεί η μορφή των δεδομένων προς υποβολή στις αρμόδιες αρχές και στην ΕΑΚΑΑ, ώστε να δημιουργηθούν αποδοτικοί δίαυλοι επικοινωνίας με τους τόπους διαπραγμάτευσης και τους ΠΕΔ και να διασφαλιστεί η έγκαιρη και ορθή δημοσίευση των απαιτούμενων δεδομένων.
- (8) Ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 600/2014 ορίζει ότι η ΕΑΚΑΑ πρέπει να δημοσιεύει, για χρηματοπιστωτικά μέσα στα οποία εφαρμόζεται ο μηχανισμός μέγιστου ορίου συναλλαγών, υπολογισμούς του συνολικού όγκου των συναλλαγών κατά τη διάρκεια των προηγούμενων 12 μηνών, και των ποσοστών των συναλλαγών με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής και της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς, ανά την Ένωση και για κάθε τόπο διαπραγμάτευσης κατά τη διάρκεια των προηγούμενων 12 μηνών. Στην περίπτωση χρηματοπιστωτικών μέσων που τελούν υπό διαπραγμάτευση σε περισσότερα του ενός νομίσματα, είναι αναγκαίο να μετατρέπονται οι όγκοι των συναλλαγών που εκτελούνται στα διάφορα νομίσματα σε ένα κοινό νόμισμα, προκειμένου να μπορούν να αθροιστούν αυτοί οι όγκοι και να πραγματοποιηθούν οι απαιτούμενοι υπολογισμοί. Επομένως, θα πρέπει να προβλέπεται η μεθοδολογία και οι συναλλαγματικές ισοτιμίες για τη μετατροπή, εφόσον είναι αναγκαίο, των όγκων συναλλαγών.
- (9) Για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, οι τόποι διαπραγμάτευσης θα πρέπει να υποχρεούνται να αναφέρουν τους όγκους των συναλλαγών που έχουν εκτελεστεί με χρήση της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς και, στην περίπτωση ευχερώς ρευστοποιήσιμων μέσων, με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής. Δεδομένου ότι οι απαλλαγές εφαρμόζονται σε εντολές και όχι σε συναλλαγές, είναι σημαντικό να διασαφηνιστεί ότι οι όγκοι που πρέπει να αναφέρονται θα πρέπει να περιλαμβάνουν όλες τις συναλλαγές που φέρουν σήμανση «RFPT» (σήμανση συναλλαγής βάσει τιμής αναφοράς) ή «NLIQ» (σήμανση διαπραγματευθείσας συναλλαγής σε ευχερώς ρευστοποιήσιμα χρηματοπιστωτικά μέσα) για σκοπούς μετασυναλλακτικής δημοσίευσης συναλλαγών και όπως προσδιορίζεται στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2017/587. Στην περίπτωση που έχει εκτελεστεί συναλλαγή με βάση δύο εντολές που επωφελούνται από τη μεγάλη μεγέθους απαλλαγή, αυτή η συναλλαγή δεν θα πρέπει να προσμετράται στους όγκους που υπολογίζονται με βάση την απαλλαγή λόγω τιμής αναφοράς και την απαλλαγή λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής.
- (10) Για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, οι τόποι διαπραγμάτευσης και οι ΠΕΔ θα πρέπει να διασφαλίζουν ότι ο τόπος διαπραγμάτευσης στον οποίο εκτελέστηκε η συναλλαγή ταυτοποιείται με επαρκή βαθμό

λεπτομέρειας, ούτως ώστε η ΕΑΚΑΑ να είναι σε θέση να πραγματοποιήσει όλους τους υπολογισμούς που αναφέρονται στον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014. Ειδικότερα, ο χρησιμοποιούμενος αναγνωριστικός κωδικός του τόπου διαπραγμάτευσης θα πρέπει να είναι μοναδικός για τον συγκεκριμένο τόπο διαπραγμάτευσης και να μην χρησιμοποιείται από άλλον τόπο διαπραγμάτευσης τον οποίο διαχειρίζεται ο ίδιος διαχειριστής της αγοράς. Οι αναγνωριστικοί κωδικοί των τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να επιτρέπουν στην ΕΑΚΑΑ να διακρίνει, κατά τρόπο που δεν επιδέχεται αμφισβήτηση, όλους τους τόπους διαπραγμάτευσης για τους οποίους ο διαχειριστής της αγοράς έχει λάβει συγκεκριμένη άδεια, δυνάμει της οδηγίας 2014/65/ΕΕ.

- (11) Για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, είναι αναγκαίο να υποχρεώνονται οι τόποι διαπραγμάτευσης να υποβάλουν μια πρώτη αναφορά κατά την ημερομηνία έναρξης εφαρμογής της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, η οποία θα αναφέρει τους όγκους συναλλαγών με χρήση της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς και, στην περίπτωση ευχερώς ρευστοποιήσιμων μέσων, με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής κατά το προηγούμενο ημερολογιακό έτος. Για να διασφαλιστεί η αναλογική εφαρμογή αυτής της απαίτησης, οι τόποι διαπραγμάτευσης θα πρέπει, για αυτόν τον σκοπό, να βασίζονται στην αναφορά τους στους προσαρμοσμένους όγκους συναλλαγών οι οποίες εκτελέστηκαν με χρήση ισοδύναμων απαλλαγών που προβλέπονται στην οδηγία 2004/39/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽¹⁾ και στον κανονισμό (ΕΚ) αριθ. 1287/2006 της Επιτροπής ⁽²⁾.
- (12) Για να παρέχουν ακριβή δεδομένα στις αρμόδιες αρχές και στην ΕΑΚΑΑ, οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ θα πρέπει να διασφαλίζουν ότι οι αναφορές τους περιλαμβάνουν συναλλαγές που έχουν προσμετρηθεί μόνο μία φορά.
- (13) Οι διατάξεις του παρόντος κανονισμού είναι στενά συνδεδεμένες, δεδομένου ότι όλες αφορούν τον καθορισμό του περιεχομένου, της συχνότητας, της μορφής των αιτημάτων για παροχή δεδομένων, της μεθόδου που θα χρησιμοποιηθεί για την επεξεργασία αυτών των δεδομένων και άλλων προδιαγραφών σχετικά με τη δημοσίευση πληροφοριών για σκοπούς διαφάνειας, όπως ορίζεται στον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014. Για να διασφαλιστεί η συνεκτικότητα μεταξύ αυτών των διατάξεων, οι οποίες θα τεθούν σε ισχύ ταυτόχρονα, και για να παρασχεθεί μια συνολική εικόνα στα ενδιαφερόμενα μέρη, και ιδίως σε όσα υπόκεινται σε υποχρεώσεις, είναι σκόπιμο οι διατάξεις αυτές να συμπεριληφθούν σε έναν ενιαίο κανονισμό.
- (14) Για λόγους συνέπειας και προκειμένου να διασφαλιστεί η ομαλή λειτουργία των χρηματοπιστωτικών αγορών, είναι αναγκαίο οι διατάξεις που προβλέπονται στον παρόντα κανονισμό και εκείνες που προβλέπονται στον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014 να εφαρμόζονται από την ίδια ημερομηνία.
- (15) Ο παρών κανονισμός βασίζεται στα σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων που υπέβαλε η ΕΑΚΑΑ στην Επιτροπή.
- (16) Η ΕΑΚΑΑ διενήργησε ανοικτές δημόσιες διαβουλεύσεις σχετικά με τα σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων στα οποία βασίζεται ο παρών κανονισμός, προέβη σε ανάλυση του δυνητικού σχετικού κόστους και οφέλους και ζήτησε τη γνώμη της ομάδας συμφεροντούχων κινητών και αγορών, που συστάθηκε σύμφωνα με το άρθρο 37 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽³⁾,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Αντικείμενο και πεδίο εφαρμογής

1. Ο παρών κανονισμός καθορίζει τις λεπτομέρειες των αιτημάτων για παροχή δεδομένων, που θα αποστέλλονται από τις αρμόδιες αρχές, και τις λεπτομέρειες της απάντησης σε αυτά τα αιτήματα, η οποία θα αποστέλλεται από τόπους διαπραγμάτευσης, εγκεκριμένους μηχανισμούς δημοσίευσης (ΕΜΔ) και παρόχους ενοποιημένων δελτίων (ΠΕΔ), για σκοπούς υπολογισμού και προσαρμογής των καθεστώτων που αφορούν την προσυναλλακτική και μετασυναλλακτική διαφάνεια και την υποχρέωση διαπραγμάτευσης και, ιδίως, για σκοπούς προσδιορισμού των ακόλουθων στοιχείων:

- α) αν οι μετοχές, τα μετοχικά και τα μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα διαθέτουν ρευστή αγορά·
- β) των ορίων για απαλλαγές λόγω προσυναλλακτικής διαφάνειας για μετοχές, μετοχικά και μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα·

⁽¹⁾ Οδηγία 2004/39/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 21ης Απριλίου 2004, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων, για την τροποποίηση των οδηγιών 85/611/ΕΟΚ και 93/6/ΕΟΚ του Συμβουλίου και της οδηγίας 2000/12/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου και για την κατάργηση της οδηγίας 93/22/ΕΟΚ του Συμβουλίου (ΕΕ L 145 της 30.4.2004, σ. 1).

⁽²⁾ Κανονισμός (ΕΚ) αριθ. 1287/2006 της Επιτροπής, της 10ης Αυγούστου 2006, για την εφαρμογή της οδηγίας 2004/39/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά τις υποχρεώσεις τήρησης αρχείων για τις επιχειρήσεις επενδύσεων, τη γνωστοποίηση συναλλαγών, τη διαφάνεια της αγοράς, την εισαγωγή χρηματοπιστωτικών μέσων προς διαπραγμάτευση, καθώς και τους ορισμούς που ισχύουν για τους σκοπούς της οδηγίας αυτής (ΕΕ L 241 της 2.9.2006, σ. 1).

⁽³⁾ Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών), την τροποποίηση της απόφασης αριθ. 716/2009/ΕΚ και την κατάργηση της απόφασης 2009/77/ΕΚ της Επιτροπής (ΕΕ L 331 της 15.12.2010, σ. 84).

- γ) των ορίων για χρονική μετάθεση λόγω μετασυναλλακτικής διαφάνειας για μετοχές, μετοχικά και μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα·
- δ) πότε η ρευστότητα μιας κατηγορίας χρηματοπιστωτικών μέσων καθίσταται χαμηλότερη από ένα προκαθορισμένο όριο·
- ε) αν μια επιχείρηση επενδύσεων είναι συστηματικός εσωτερικοποιητής·
- στ) του συνήθους μεγέθους συναλλαγών της αγοράς που ισχύει για συστηματικούς εσωτερικοποιητές οι οποίοι διαπραγματεύονται επί μετοχών και μετοχικών χρηματοπιστωτικών μέσων, και του συγκεκριμένου μεγέθους ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που ισχύει για συστηματικούς εσωτερικοποιητές οι οποίοι διαπραγματεύονται επί μη μετοχικών χρηματοπιστωτικών μέσων·
- ζ) για μετοχές και μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα, του συνολικού όγκου συναλλαγών κατά τους προηγούμενους 12 μήνες, και των ποσοστών των συναλλαγών που εκτελέστηκαν με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής και της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς σε ολόκληρη την Ένωση και για κάθε τόπο διαπραγμάτευσης κατά τη διάρκεια των προηγούμενων 12 μηνών·
- η) αν τα παράγωγα είναι επαρκώς ευχερώς ρευστοποιήσιμα για σκοπούς εφαρμογής της υποχρέωσης διαπραγμάτευσης για παράγωγα.

Άρθρο 2

Περιεχόμενο των αιτημάτων για παροχή δεδομένων και των πληροφοριών που πρέπει να υποβάλλονται

1. Για σκοπούς πραγματοποίησης υπολογισμών οι οποίοι εκτελούνται σε προκαθορισμένες ημερομηνίες ή με προκαθορισμένη συχνότητα, οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ παρέχουν στις αρμόδιες αρχές τους όλα τα δεδομένα που απαιτούνται για την πραγματοποίηση των υπολογισμών που ορίζονται στους κατωτέρω κανονισμούς:
 - α) στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2017/587·
 - β) στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2017/583·
 - γ) στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2017/567·
 - δ) στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2017/565.
2. Οι αρμόδιες αρχές δύναται να ζητούν, όταν είναι αναγκαίο, συμπληρωματικές πληροφορίες για σκοπούς παρακολούθησης και προσαρμογής των ορίων και των παραμέτρων που αναφέρονται στο άρθρο 1 στοιχεία α) έως στ) και η) από τους τόπους διαπραγμάτευσης, τους ΕΜΔ και τους ΠΕΔ.
3. Οι αρμόδιες αρχές ενδέχεται να ζητούν όλα τα δεδομένα τα οποία απαιτείται να λαμβάνει υπόψη της η ΕΑΚΑΑ, σύμφωνα με τον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2016/2020, για μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα, συμπεριλαμβανομένων δεδομένων για τα ακόλουθα:
 - α) τη μέση συχνότητα των συναλλαγών·
 - β) το μέσο μέγεθος και την κατανομή των συναλλαγών·
 - γ) τον αριθμό και το είδος των συμμετεχόντων στην αγορά·
 - δ) το μέσο μέγεθος ανοίγματος τιμών.

Άρθρο 3

Συχνότητα αιτημάτων για παροχή δεδομένων και χρόνοι απόκρισης από τόπους διαπραγμάτευσης, ΕΜΔ και ΠΕΔ

1. Οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ υποβάλλουν καθημερινά τα δεδομένα που αναφέρονται στο άρθρο 2 παράγραφος 1.
2. Οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ υποβάλλουν τα δεδομένα ως απάντηση σε αίτημα ad hoc αναφερόμενο στο άρθρο 2 παράγραφος 2, εντός τεσσάρων εβδομάδων από τη λήψη του εν λόγω αιτήματος, εκτός εάν απαιτείται απάντηση εντός μικρότερου χρονικού διαστήματος λόγω εξαιρετικών περιστάσεων, όπως διευκρινίζεται στο αίτημα.
3. Κατά παρέκκλιση από τις παραγράφους 1 και 2, οι τόποι διαπραγμάτευσης και οι ΠΕΔ υποβάλλουν δεδομένα τα οποία χρησιμοποιούνται για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών, όπως ορίζεται στο άρθρο 6 παράγραφοι 6 έως 9.

Άρθρο 4

Μορφή των αιτημάτων για παροχή δεδομένων

Οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ υποβάλλουν τα δεδομένα που αναφέρονται στο άρθρο 2 σε μορφή κοινού αρχείου XML και, εφόσον υπάρχουν, σύμφωνα με οποιοσδήποτε άλλες προδιαγραφές όσον αφορά το περιεχόμενο και τη μορφή, οι οποίες έχουν καθοριστεί προκειμένου να διευκολύνεται μια αποδοτική και αυτοματοποιημένη διαδικασία παράδοσης των δεδομένων και η ενοποίησή τους με παρόμοια δεδομένα από άλλες πηγές.

Άρθρο 5

Είδος δεδομένων που πρέπει να αποθηκεύονται και ελάχιστη περίοδος αποθήκευσης δεδομένων από τόπους διαπραγμάτευσης, ΕΜΔ και ΠΕΔ

1. Οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ αποθηκεύουν όλα τα δεδομένα που απαιτούνται για τον υπολογισμό, την παρακολούθηση ή την προσαρμογή των ορίων και των παραμέτρων που αναφέρονται στο άρθρο 2, ανεξαρτήτως του αν αυτές οι πληροφορίες έχουν δημοσιοποιηθεί ή όχι.
2. Οι τόποι διαπραγμάτευσης, οι ΕΜΔ και οι ΠΕΔ αποθηκεύουν τα δεδομένα που αναφέρονται στην παράγραφο 1 για τουλάχιστον τρία έτη.

Άρθρο 6

Απαιτήσεις υποβολής αναφορών από τόπους διαπραγμάτευσης και ΠΕΔ για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών

1. Για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο που υπόκειται στις απαιτήσεις διαφάνειας του άρθρου 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν τα ακόλουθα δεδομένα στην αρμόδια αρχή:
 - α) τον συνολικό όγκο των συναλλαγών επί του χρηματοπιστωτικού μέσου οι οποίες εκτελέστηκαν στον συγκεκριμένο τόπο διαπραγμάτευσης·
 - β) τους συνολικούς όγκους των συναλλαγών επί του χρηματοπιστωτικού μέσου οι οποίες εκτελέστηκαν στον συγκεκριμένο τόπο διαπραγμάτευσης με τη χρήση των απαλλαγών του άρθρου 4 παράγραφος 1 στοιχείο α) ή του άρθρου 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, αντιστοίχως, με χωριστή αναφορά των συνολικών όγκων για κάθε απαλλαγή.
2. Για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο που υπόκειται στις απαιτήσεις διαφάνειας του άρθρου 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, και εφόσον ζητηθεί από την αρμόδια αρχή, οι ΠΕΔ υποβάλλουν στην αρμόδια αρχή τα ακόλουθα δεδομένα:
 - α) τους συνολικούς όγκους των συναλλαγών επί του χρηματοπιστωτικού μέσου οι οποίες εκτελέστηκαν σε όλους τους τόπους διαπραγμάτευσης στην Ένωση, με χωριστή αναφορά των συνολικών όγκων για κάθε τόπο διαπραγμάτευσης·
 - β) τους συνολικούς όγκους των συναλλαγών οι οποίες εκτελέστηκαν σε όλους τους τόπους διαπραγμάτευσης στην Ένωση με τη χρήση των απαλλαγών του άρθρου 4 παράγραφος 1 στοιχείο α) ή του άρθρου 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, αντιστοίχως, με χωριστή αναφορά των συνολικών όγκων για κάθε απαλλαγή και για κάθε τόπο διαπραγμάτευσης.
3. Οι τόποι διαπραγμάτευσης και οι ΠΕΔ υποβάλλουν τα στοιχεία που ορίζονται στις παραγράφους 1 και 2 στην αρμόδια αρχή με τη μορφή που ορίζεται στο παράρτημα. Διασφαλίζουν, ιδίως, ότι οι αναγνωριστικοί κωδικοί των τόπων διαπραγμάτευσης τους οποίους δηλώνουν είναι επαρκώς λεπτομερείς, ώστε η αρμόδια αρχή και η ΕΑΚΑΑ να είναι σε θέση να ταυτοποιήσουν τους όγκους των συναλλαγών που έχουν εκτελεστεί με χρήση της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς και, για ευχερώς ρευστοποιήσιμα χρηματοπιστωτικά μέσα, με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής, σε κάθε τόπο συναλλαγών, και να μπορούν να υπολογίσουν το ποσοστό που ορίζεται στο άρθρο 5 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.
4. Για σκοπούς υπολογισμού των όγκων που αναφέρονται στις παραγράφους 1 και 2:
 - α) ο όγκος μιας επιμέρους συναλλαγής προσδιορίζεται πολλαπλασιάζοντας την τιμή του χρηματοπιστωτικού μέσου με τον αριθμό των υπό διαπραγμάτευση μονάδων·
 - β) ο συνολικός όγκος των συναλλαγών σε κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο που ορίζεται στην παράγραφο 1 στοιχείο α) και στην παράγραφο 2 στοιχείο α) προσδιορίζεται αθροίζοντας τον όγκο όλων των επιμέρους συναλλαγών, οι οποίες έχουν προσμετρηθεί μόνο μία φορά, για το συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο·
 - γ) οι όγκοι συναλλαγών που ορίζονται στην παράγραφο 1 στοιχείο β) και στην παράγραφο 2 στοιχείο β) προσδιορίζονται αθροίζοντας τους όγκους των επιμέρους συναλλαγών, οι οποίες έχουν προσμετρηθεί μόνο μία φορά, για το συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο και οι οποίες φέρουν τη σήμανση «τιμή αναφοράς» και «διαπραγματευθείσες συναλλαγές σε ευχερώς ρευστοποιήσιμα χρηματοπιστωτικά μέσα», σύμφωνα με τον πίνακα 4 του παραρτήματος Ι του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/587.

5. Οι τόποι διαπραγμάτευσης και οι ΠΕΔ αθροίζουν μόνο συναλλαγές οι οποίες έχουν εκτελεστεί στο ίδιο νόμισμα και αναφέρουν χωριστά κάθε συνολικό όγκο στο νόμισμα που έχει χρησιμοποιηθεί για τις συναλλαγές.
6. Οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν τα δεδομένα που αναφέρονται στις παραγράφους 1 έως 5 στην αρμόδια αρχή την πρώτη και τη δέκατη έκτη ημέρα κάθε ημερολογιακού μήνα έως τις 13:00 ώρα Κεντρικής Ευρώπης. Όταν η πρώτη ή η δέκατη έκτη ημέρα του ημερολογιακού μήνα δεν είναι εργάσιμη ημέρα για τον τόπο διαπραγμάτευσης, ο τόπος διαπραγμάτευσης υποβάλλει τα δεδομένα στην αρμόδια αρχή έως τις 13:00 ώρα Κεντρικής Ευρώπης την επόμενη εργάσιμη ημέρα.
7. Οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν στην αρμόδια αρχή τους συνολικούς όγκους συναλλαγών, που προσδιορίζονται σύμφωνα με τις παραγράφους 1 έως 5, όσον αφορά τις ακόλουθες χρονικές περιόδους:
- α) για αναφορές που υποβάλλονται τη δέκατη έκτη ημέρα κάθε ημερολογιακού μήνα, η περίοδος εκτέλεσης είναι από την πρώτη έως τη δέκατη πέμπτη ημέρα του ίδιου ημερολογιακού μήνα·
- β) για αναφορές που υποβάλλονται την πρώτη ημέρα κάθε ημερολογιακού μήνα, η περίοδος εκτέλεσης είναι από τη δέκατη έκτη έως την τελευταία ημέρα του προηγούμενου ημερολογιακού μήνα.
8. Κατά παρέκκλιση από τις παραγράφους 6 και 7, οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν την πρώτη αναφορά για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο κατά την ημερομηνία έναρξης εφαρμογής της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, έως τις 13:00 ώρα Κεντρικής Ευρώπης, και περιλαμβάνουν σε αυτήν τους όγκους συναλλαγών που αναφέρονται στην παράγραφο 1 για το προηγούμενο ημερολογιακό έτος. Για αυτόν τον σκοπό, οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν χωριστά, για κάθε ημερολογιακό μήνα, τα ακόλουθα στοιχεία:
- α) τους όγκους συναλλαγών κατά τη διάρκεια της περιόδου από την πρώτη έως τη δέκατη πέμπτη ημέρα κάθε ημερολογιακού μήνα·
- β) τους όγκους συναλλαγών κατά τη διάρκεια της περιόδου από τη δέκατη έκτη έως την τελευταία ημέρα κάθε ημερολογιακού μήνα.
9. Οι τόποι διαπραγμάτευσης και οι ΠΕΔ ανταποκρίνονται σε οποιοδήποτε αίτημα ad hoc των αρμόδιων αρχών για τον όγκο των συναλλαγών σε σχέση με τον υπολογισμό που πρέπει να πραγματοποιηθεί για την παρακολούθηση της χρήσης της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς ή της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής, έως το πέρας των εργασιών κατά την πρώτη εργάσιμη ημέρα μετά την υποβολή του αιτήματος.

Άρθρο 7

Απαιτήσεις υποβολής αναφορών από τις αρμόδιες αρχές προς την ΕΑΚΑΑ για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών και της υποχρέωσης διαπραγμάτευσης για παράγωγα

1. Οι αρμόδιες αρχές παρέχουν στην ΕΑΚΑΑ τα δεδομένα που λαμβάνουν από έναν τόπο διαπραγμάτευσης ή ΠΕΔ, σύμφωνα με το άρθρο 6, έως τις 13:00 ώρα Κεντρικής Ευρώπης κατά την πρώτη εργάσιμη ημέρα μετά τη λήψη τους.
2. Οι αρμόδιες αρχές παρέχουν στην ΕΑΚΑΑ τα δεδομένα που λαμβάνουν από έναν τόπο διαπραγμάτευσης, ΕΜΔ ή ΠΕΔ προκειμένου να προσδιοριστεί αν τα παράγωγα είναι επαρκώς ευχερώς ρευστοποιήσιμα, όπως αναφέρεται στο άρθρο 1 στοιχείο η), χωρίς καθυστέρηση και το αργότερο εντός τριών εργάσιμων ημερών από τη λήψη των σχετικών δεδομένων.

Άρθρο 8

Απαιτήσεις υποβολής αναφορών από την ΕΑΚΑΑ για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών

1. Η ΕΑΚΑΑ δημοσιεύει τους υπολογισμούς του συνολικού όγκου συναλλαγών για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο κατά τους προηγούμενους 12 μήνες, και των ποσοστών των συναλλαγών με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής και της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς, σε ολόκληρη την Ένωση και για κάθε τόπο διαπραγμάτευσης κατά τη διάρκεια των προηγούμενων 12 μηνών, σύμφωνα με το άρθρο 5 παράγραφοι 4, 5 και 6 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, το αργότερο έως τις 22:00 ώρα Κεντρικής Ευρώπης, την πέμπτη εργάσιμη ημέρα μετά το τέλος των περιόδων υποβολής αναφορών που ορίζονται στο άρθρο 6 παράγραφος 6 του παρόντος κανονισμού.
2. Η δημοσίευση που αναφέρεται στην παράγραφο 1 πραγματοποιείται δωρεάν και σε μορφή η οποία είναι αναγνώσιμη τόσο από άνθρωπο όσο και από μηχανήματα, όπως ορίζεται στο άρθρο 14 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/571⁽¹⁾ της Επιτροπής και στο άρθρο 13 παράγραφοι 4 και 5 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/567.

⁽¹⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/571 της Επιτροπής, της 2ας Ιουνίου 2016, για τη συμπλήρωση της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα σχετικά με τη χορήγηση άδειας λειτουργίας, τις οργανωτικές απαιτήσεις και τη δημοσίευση συναλλαγών για παρόχους υπηρεσιών αναφοράς δεδομένων (βλέπε σ. 126 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

3. Εάν ένα χρηματοπιστωτικό μέσο τελεί υπό διαπραγμάτευση σε περισσότερα από ένα νομίσματα στην Ένωση, η ΕΑΚΑΑ μετατρέπει όλους τους όγκους σε ευρώ, με τη χρήση των μέσων συναλλαγματικών ισοτιμιών που υπολογίζονται με βάση τις ημερήσιες συναλλαγματικές ισοτιμίες αναφοράς του ευρώ, οι οποίες δημοσιεύθηκαν από την Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα στον δικτυακό τόπο της κατά τους προηγούμενους 12 μήνες. Μετά τη μετατροπή τους, αυτοί οι όγκοι χρησιμοποιούνται για τον υπολογισμό και τη δημοσίευση του συνολικού όγκου συναλλαγών, και των ποσοστών των συναλλαγών με χρήση της απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής και της απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς, σε ολόκληρη την Ένωση και σε κάθε τόπο διαπραγμάτευσης, όπως αναφέρεται στην παράγραφο 1.

Άρθρο 9

Έναρξη ισχύος και εφαρμογή

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης.

Εφαρμόζεται από τις 3 Ιανουαρίου 2018.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

Βρυξέλλες, 13 Ιουνίου 2016.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
Jean-Claude JUNCKER

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Πίνακας 1

Πίνακας συμβόλων για τον πίνακα 2

ΣΥΜΒΟΛΟ	ΤΥΠΟΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ	ΟΡΙΣΜΟΣ
{ALPHANUM-n}	Έως n αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Πεδίο με ελεύθερο κείμενο.
{DECIMAL-n/m}	Δεκαδικός αριθμός με έως n ψηφία συνολικά, εκ των οποίων έως m ψηφία μπορεί να είναι κλασματικά ψηφία	Αριθμητικό πεδίο τόσο για θετικές όσο και για αρνητικές τιμές. — σημείο υποδιαστολής: «.» (τελεία) — ο αριθμός μπορεί να συνοδεύεται από πρόθημα «-» (μείον), το οποίο υποδηλώνει αρνητικό αριθμό. Κατά περίπτωση, οι τιμές στρογγυλοποιούνται και δεν περικόπτονται.
{CURRENCYCODE_3}	3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός νομίσματος με 3 γράμματα, όπως ορίζεται με τους κωδικούς νομίσματος ISO 4217.
{DATEFORMAT}	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	Οι ημερομηνίες θα πρέπει να έχουν τον εξής μορφότυπο: EEEE-MM-HH.
{ISIN}	12 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός ISIN, όπως ορίζεται στο ISO 6166.
{MIC}	4 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς, όπως ορίζεται στο ISO 10383.

Πίνακας 2

Μορφότυποι της αναφοράς για τους σκοπούς του μηχανισμού μέγιστου ορίου συναλλαγών

Όνομα πεδίου δεδομένων	Μορφότυπος
Περίοδος υποβολής αναφοράς	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} όπου η πρώτη ημερομηνία είναι η έναρξη της περιόδου υποβολής αναφοράς και η δεύτερη ημερομηνία είναι το τέλος της περιόδου υποβολής αναφοράς.
Αναγνωριστικός κωδικός της αναφέρουσας οντότητας	Εάν η αναφέρουσα οντότητα είναι τόπος διαπραγμάτευσης: {MIC} (κωδικός MIC τμήματος ή, ανάλογα με την περίπτωση, κωδικός MIC δραστηριότητας) ή {ALPHANUM-50} εάν η αναφέρουσα οντότητα είναι ΠΕΔ.
Αναγνωριστικός κωδικός τόπου διαπραγμάτευσης	{MIC} (κωδικός MIC τμήματος ή, όπου είναι διαθέσιμος, κωδικός MIC δραστηριότητας)
Αναγνωριστικός κωδικός μέσου	{ISIN}
Νόμισμα συναλλαγών	{CURRENCYCODE_3}
Συνολικός όγκος συναλλαγών (ανά νόμισμα)	{DECIMAL-18/5}

Όνομα πεδίου δεδομένων	Μορφότυπος
Συνολικός όγκος συναλλαγών με χρήση απαλλαγής λόγω τιμής αναφοράς, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού MiFIR (ανά νόμισμα)	{DECIMAL-18/5}
Συνολικός όγκος συναλλαγών με χρήση απαλλαγής λόγω διαπραγματευθείσας συναλλαγής, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) περίπτωση ι) του κανονισμού MiFIR (ανά νόμισμα)	{DECIMAL-18/5}