ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2017/577 НА КОМИСИЯТА

от 13 юни 2016 година

за допълнение на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за механизма за праг на обема и предоставянето на информация за целите на прозрачността и други изчисления

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 ([1]), и по-специално член 5, параграф 9 и член 22, параграф 4 от него,

като има предвид, че:

(1) Според Регламент (ЕС) № 600/2014 се изисква компетентните органи и Европейският орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП) да извършват значителен брой изчисления, с цел да бъде съобразена приложимостта на режима на прозрачност преди и след сключването на сделките и задължението за търговия на деривати, както и за да бъде определено дали даден инвестиционен посредник е систематичен участник.

(2) Компетентните органи и ЕОЦКП трябва да могат да получат достоверни данни с високо качество за всеки клас активи, за който се прилага Регламент (ЕС) № 600/2014, за да извършват необходимите изчисления. По тази причина е необходимо да се подобри както достъпността, така и качеството на данните, с които компетентните органи и ЕОЦКП разполагат в съответствие с Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([2]) и Регламент (ЕС) № 600/2014, за да може класифицирането на финансовите инструменти, в това число праговете за целите на прозрачността преди и след сключването на сделките, а когато е необходимо — и промяната на тези прагове, да бъдат изчислявани на по-информирана база, след като режимът е прилаган в продължение на определен период от време.

(3) Следва да бъдат установени разпоредби за определяне в общ вид на елементите на съдържанието и формата на данните, които трябва да се подават от местата на търговия, одобрените механизми за публикуване (ОМП) и доставчиците на консолидирани данни (ДКД) за целите на прозрачността и други изчисления. Тези разпоредби следва да се четат във връзка с Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 на Комисията ([3]), Делегиран регламент (ЕС) 2017/583 на Комисията ([4]), Делегиран регламент (ЕС) 2017/567 на Комисията ([5]), Делегиран регламент (ЕС) 2017/565 на Комисията ([6]) и Делегиран регламент (ЕС) 2016/2020 на Комисията ([7]), в които са описани методиката и необходимите данни за извършване на съответните изчисления и за конкретизиране на съдържанието

([1]) ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 84.

([2]) Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Директива 2002/92/ЕО и на Директива 2011/61/ЕС (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 349).

([3]) Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 на Комисията от 14 юли 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за изискванията за прозрачност към местата на търговия и инвестиционните посредници по отношение на акциите, депозитарните разписки, борсово търгуваните фондове, сертификатите и другите подобни финансови инструменти, както и за задълженията за изпълнение на сделките при някои търгувани на място на търговия акции или от страна на систематичен участник (вж. стр. 387 от настоящия брой на Официален вестник)

([4]) Делегиран регламент (ЕС) 2017/583 на Комисията от 14 юли 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за изискванията за прозрачност, засягащи местата на търговия и инвестиционните посредници, във връзка с облигациите, структурираните финансови продукти, квотите за емисии и дериватите (вж. стр. 229 от настоящия брой на Официален вестник)

([5]) Делегиран регламент (ЕС) о 2017/567 на Комисията от 18 май 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на определенията, прозрачността, компресирането на портфейл и надзорните мерки за намеса по отношение на продукти и управление на позиции (вж. стр. 90 от настоящия брой на Официален вестник).

([6]) Делегиран регламент (ЕС) 2017/565 на Комисията от 25 април 2016 г. за допълване на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета по отношение на организационните изисквания и условията за извършване на дейност от инвестиционните посредници и за даването на определения за целите на посочената директива (вж. стр. 1 от настоящия брой на Официален вестник).

([7]) Делегиран регламент (ЕС) 2016/2020 на Комисията от 26 май 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за критериите за определяне дали дериватите, които подлежат на задължение за клиринг, следва да подлежат на задължение за търговия (ОВ L 313, 19.11.2016 г., стр. 2).

и обхвата на данните, необходими за извършването на изчисленията за целите на прозрачността. Затова съдържанието, форматът и качеството на данните, които са предоставени по отношение на местата на търговия, ОМП и ДКД, следва да съответстват на приложимата методика, която е определена в съответните актове за изпълнение на Директива 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 600/2014, когато се правят такива изчисления.

(4) С изключение на възможни искания за данни и изчисления, основани на ad-hoc принцип, които се налага да бъдат извършени за целите на механизма за праг на обема, местата на търговия, ОМП и ДКД следва ежедневно да представят отчети. Като се има предвид широкото приложно поле на обхванатите финансови инструменти и големият обем на данните, които следва да бъдат обработени, това ежедневно отчитане дава възможност на компетентните органи по-прецизно да обработват файлове с управляеми размери и гарантира ефективното и своевременно управление на представените данни, проверка на качеството на данните и обработване на данните. Ежедневното събиране на данни опростява също така задължението за представяне на данни от местата на търговия, ОМП и ДКД, като ги освобождава от необходимостта да изчисляват броя на дните на търговия в случаи, в които е приложим този количествен критерии за ликвидност, и да обобщават данни за един и същ финансов инструмент в различни времеви падежни цикли в случаи, в които следва да се вземе предвид срокът до падежа. Централизирането на това изчисляване осигурява също така последователно прилагане на критериите за различните финансови инструменти и места на търговия.

(5) Местата на търговия следва да съхраняват подробни данни, които дават възможност на компетентните органи и ЕОЦКП да извършват точни изчисления. Макар че изискваната информация обикновено се предоставя в отчетите след сключването на сделката, в някои случаи информацията, която е необходима за изчисленията, надхвърля съдържащата се в тези отчети информация. Това включва например информация за сделки, извършени въз основа на нареждания, ползващи освобождаване като големи по размер. Тази информация не следва да се включва в докладите за извършената търговия, тъй като това би могло да изложи съответните сделки на неблагоприятно пазарно въздействие. Тъй като обаче информацията може да е нужна на компетентните органи да извършват точни изчисления, тя следва да се съхранява правилно от местата на търговия, ОМП и ДКД и да бъде съобщавана на компетентните органи и ЕОЦКП, когато това е необходимо. Местата на търговия следва да гарантират правилното разпространение на информацията, която подлежи на предоставяне на компетентните органи и ЕОЦКП. Сделките, изпълнявани въз основа на големи по размер нареждания, следва да бъдат надлежно указани в отчитането им пред ДКД.

(6) Данни следва да се събират от различни източници, тъй като един-единствен източник не винаги може да притежава пълен набор от данни за даден клас активи или дори конкретен инструмент. Поради това, за да се осигури възможност за компетентните органи и ЕОЦКП да получават и консолидират данни с високо качество от различни източници, местата на търговия, ОМП и ДКД следва да използват предварително определени спецификации, що се отнася до съдържание и формат, когато такива има на разположение, с цел събирането на данни да се улесни и да стане икономически по-изгодно.

(7) Като се има предвид чувствителността на необходимите изчисления и потенциалните търговски последици за местата на търговия, емитентите и други участници на пазара от публикуването на неточна информация, което би могло да доведе, в случая на механизма за праг на обема, до спиране на използването на освобождавания за дадено конкретно място или в целия Съюз за даден конкретен финансов инструмент, съществено важно е да бъде разяснен форматът на данните, които следва да бъдат подавани към компетентните органи и ЕОЦКП, за да се създадат ефективни комуникационни канали с местата на търговия и ДКД и да се гарантира своевременното и правилно публикуване на изискваните данни.

(8) Що се отнася до финансови инструменти, за които се прилага механизмът за праг на обема, според Регламент (ЕС) № 600/2014 се изисква ЕОЦКП да публикува параметрите на общия обем на търговията през предходните 12 месеца и процента на търговията с освобождавания както за договорена сделка, така и за референтна цена в целия Съюз и във всяко място на търговия през предходните 12 месеца. В случай на финансови инструменти, които се търгуват в повече от една валута, следва обемите, за които са сключени сделки в различни валути, да бъдат конвертирани в една обща валута, за да се даде възможност за пресмятане на въпросните обеми и извършване на изискваните изчисления. Поради това следва да бъдат определени методиката и обменните курсове, които да се използват, когато е нужно, за конвертиране на търгуваните обеми.

(9) За целите на механизма за праг на обема, от местата на търговия следва да се изисква да докладват търгуваните обеми по освобождаването за референтна цена и, що се отнася до ликвидни инструменти, освобождаването за договорена сделка. Като се има предвид, че освобожденията са приложими за нареждания, а не за сделки, важно е да се поясни, че обемите, които подлежат на докладване, следва да включват всички сделки, обозначени с „RFPT“ или „NLIQ“, за целите на публикуването на сделки след сключването им и както е посочено в Делегиран регламент (ЕС) 2017/587. Когато дадена сделка е била сключена въз основа на две нареждания, ползващи освобождаване като големи по размер, тази сделка не следва да се включва в обемите, които се изчисляват по освобождаването за референтна цена и освобождаването за договорена сделка.

(10) За целите на механизма за праг на обема местата на търговия и ДКД следва да гарантират, че мястото на търговия, на което е била изпълнена сделката, е определено достатъчно подробно, за да може ЕОЦКП да направи всички изчисления, предвидени в Регламент (ЕС) № 600/2014. По-специално, използваният идентификатор за мястото на

търговия следва да бъде уникален за въпросното място на търговия и да не се споделя с никое друго място на търговия, управлявано от същия пазарен оператор. Идентификаторите на местата на търговия следва да позволяват на ЕОЦКП да разграничава по недвусмислен начин всички места на търговия, за които пазарният оператор е получил специален лиценз съгласно Директива 2014/65/ЕС.

(11) За целите на механизма за праг на обема е необходимо местата на търговия да бъдат задължени да представят първия отчет за обема на търговските сделки по освобождаването за референтна цена и, що се отнася до ликвидни инструменти, освобождаването за договорена сделка за предходната календарна година, на датата на влизане в сила на Директива 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 600/2014. С оглед на осигуряването на съответстващо прилагане на това изискване, местата на търговия следва за целта да изготвят своя отчет на основата на адаптираните обеми на търговията, реализирани при равностойни освобождавания, предвидени в Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([1]) и Регламент (ЕО) № 1287/2006 на Комисията ([2]).

(12) Местата на търговия, ОМП и ДКД следва да гарантират включването само на еднократно преброени сделки в своите отчети, за да предоставят точни данни на компетентните органи и на ЕОЦКП.

(13) Предвидените в настоящия регламент разпоредби са тясно свързани, тъй като те се отнасят до определяне на съдържанието, периодичността и формата на исканията за данни, метода, който следва да се използва за обработването на тези данни, и други спецификации, свързани с публикуването на информация за целите на прозрачността, както е определено в Регламент (ЕС) № 600/2014. С цел да се гарантира съгласуваност между тези разпоредби, които ще влязат в сила едновременно, и да се предостави цялостна информация на заинтересованите страни и по-специално на онези, които попадат под действието на тези задължения, е желателно те да бъдат включени в един регламент.

(14) От съображения за съгласуваност и с цел да се гарантира безпроблемното функциониране на финансовите пазари, е необходимо определените в настоящия регламент разпоредби и разпоредбите, предвидени в Регламент (ЕС) № 600/2014, да се прилагат, считано от една и съща дата.

(15) Настоящият регламент се основава на проекта за регулаторни технически стандарти, представен от ЕОЦКП на Комисията.

(16) ЕОЦКП е провел открити обществени консултации по проекта за регулаторни технически стандарти, на който настоящият регламент е основан, анализирал е потенциалните свързани разходи и ползи и е поискал становището на Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена съгласно член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ([3]),

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Предмет и обхват

1. Настоящият регламент определя съдържанието на исканията за данни, които се изпращат от компетентните органи, и съдържанието на отговора на тези искания, които местата на търговия, одобрените механизми за публикуване (ОМП) и доставчиците на консолидирани данни (ДКД) изпращат за целите на изчисляването и съобразяването на режимите на прозрачност преди и след сключването на сделката и на задължението за търговия, по-специално с цел да бъдат определени следните елементи:

а) дали има ликвиден пазар на капиталови, подобни на капиталовите и некапиталови финансови инструменти;

б) праговете за освобождавания от задълженията за прозрачност преди сключването на сделки за капиталови, подобни на капиталовите и некапиталови финансови инструменти;

([1]) Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 21 април 2004 г. относно пазарите на финансови инструменти, за изменение на Директиви 85/611/ЕИО и 93/6/ЕИО на Съвета и Директива 2000/12/ЕО на Европейския парламент и на Съвета и за отмяна на Директива 93/22/ЕИО на Съвета (ОВ L 145, 30.4.2004 г., стр. 1).

([2]) Регламент (ЕО) № 1287/2006 на Комисията от 10 август 2006 г. за прилагане на Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета по отношение на задълженията за водене на регистри за инвестиционните посредници, отчитането на сделките, прозрачността на пазара, допускането на финансови инструменти за търгуване, както и за определените понятия за целите на посочената директива (ОВ L 241, 2.9.2006 г., стр. 1).

([3]) Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

в) праговете за отлагания на задълженията за прозрачност след сключването на сделки за капиталови, подобни на капиталовите и некапиталови финансови инструменти;

г) кога ликвидността на даден клас финансови инструменти спада под определен праг;

д) дали даден инвестиционен посредник е систематичен участник;

е) стандартният размер на пазара, който се прилага за систематични участници, търгуващи с капиталови и подобни на капиталовите инструменти, и специфичния за инструмента размер, който се прилага за систематични участници, търгуващи с некапиталови инструменти;

ж) по отношение на капиталовите и подобните на капиталовите инструменти — общият обем на търговията за предходните 12 месеца и процентите на търговията, извършена при режимите на освобождавания, както за договорена сделка, така и за референтна цена, в целия Съюз и за всяко място на търговия през предходните 12 месеца;

з) дали дериватите са достатъчно ликвидни за целите на изпълнението на задължението за търговия на деривати.

Член 2

Съдържание на исканията за данни и информацията, която подлежи на докладване

1. За целите на изпълнението на изчисленията, които се осъществяват на предварително насрочени дати или с предварително определена периодичност, местата на търговия, ОМП и ДКД предоставят на своите компетентни органи всички данни, които се изискват за извършване на изчисленията, предвидени в следните регламенти:

а) Делегиран регламент (ЕС) 2017/587;

б) Делегиран регламент (ЕС) 2017/583;

в) Делегиран регламент (ЕС) 2017/567;

г) Делегиран регламент (ЕС) 2017/565.

2. Компетентните органи могат при нужда да изискват от местата на търговия, ОМП и ДКД допълнителна информация за целите на мониторинга и адаптирането на праговете и параметрите, посочени в букви а) — е) и з) от член 1.

3. Компетентните органи могат да изискват всички данни, които ЕОЦКП трябва да взема предвид в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2016/2020, включително данни за следното:

а) средната честота на търговските сделки;

б) средния размер и разпространение на търговските сделки;

в) броя и вида на участниците на пазара;

г) средния размер на спредовете.

Член 3

Периодичност на исканията за данни и срокове за отговор на местата на търговия, ОМП и ДКД

1. Местата на търговия, ОМП и ДКД предоставят данните, посочени в член 2, параграф 1, ежедневно.

2. Местата на търговия, ОМП и ДКД предоставят данните в отговор на *ad hoc* искане, съгласно посоченото в член 2, параграф 2, в срок до четири седмици, считано от получаване на искането, освен ако извънредни обстоятелства изискват отговор в по-кратки срокове според посоченото в искането.

3. Чрез дерогация от параграфи 1 и 2 местата на търговия и ДКД предоставят данни за използване за целите на механизма за праг на обема, както е посочено в член 6, параграфи 6—9.

Член 4

Формат на исканията за данни

Местата на търговия, ОМП и ДКД предоставят данните, посочени в член 2, в общ файлов XML формат и в съответствие с всички други спецификации, ако има такива, касаещи съдържанието и формата и определени с цел да се улесни ефективния и автоматизиран процес на предоставяне на данни, както и консолидирането им с аналогични данни от други източници.

Член 5

Видове данни, подлежащи на съхраняване, и минимален срок, за който местата на търговия, ОМП и ДКД съхраняват данните

1. Местата на търговия, ОМП и ДКД съхраняват всички данни, които се изискват за изчисляване, мониторинг или адаптиране на праговете и параметрите, определени в член 2, независимо дали тази информация се оповестява публично или не.

2. Местата на търговия, ОМП и ДКД съхраняват посочените в параграф 1 данни за срок от най-малко три години.

Член 6

Изисквания за докладване от местата на търговия и ДКД за целите на механизма за праг на обема

1. За всеки финансов инструмент, обхванат от изискванията за прозрачност по член 3 от Регламент (ЕС) № 600/2014, местата на търговия предоставят на компетентния орган следните данни:

а) общия обем на търговията с финансовия инструмент, извършвана на даденото място на търговия;

б) общите обеми на търговията с финансовия инструмент, извършвана на даденото място на търговия при режимите на освобождаване съответно по член 4, параграф 1, буква а) или член 4, параграф 1, буква б), подточка i) от Регламент (ЕС) № 600/2014, като общите обеми се отчитат отделно за всяко освобождаване.

2. За всеки финансов инструмент, обхванат от изискванията за прозрачност по член 3 от Регламент (ЕС) № 600/2014, и когато компетентният орган поиска това, ДКД представя на компетентния орган следните данни:

а) общите обеми на търговията с финансовия инструмент, извършвана на всички места на търговия в Съюза, като общите обеми се отчитат отделно за всяко място на търговия;

б) общите обеми на търговията, извършвана на всички места на търговия в Съюза при режимите на освобождаване съответно по член 4, параграф 1, буква а) или член 4, параграф 1, буква б), подточка i) от Регламент (ЕС) № 600/2014, като общите обеми се отчитат отделно за всяко освобождаване и за всяко място на търговия.

3. Местата на търговия и ДКД отчитат пред компетентния орган данните, посочени в параграфи 1 и 2, като използват предвидените в приложението формати. Те гарантират по-специално, че идентификаторите на местата на търговия, които предоставят, са достатъчно подробни, за да се даде възможност на компетентния орган и ЕОЦКП да определят за всяко място на търговия обемите на търговията, извършвана при режим на освобождаване за референтна цена и за ликвидните финансови инструменти при режим на освобождаване за договорена сделка, както и да се направи възможно изчисляването на съотношението, посочено в член 5, параграф 1, буква а) от Регламент (ЕС) № 600/2014.

4. За целите на изчислението на обемите, посочени в параграфи 1 и 2:

а) обемът на отделната сделка се определя, като цената на финансовия инструмент се умножава по броя на търгуваните единици;

б) общият обем на търговията с всеки финансов инструмент, посочен в параграф 1, буква а) и параграф 2, буква а), се определя, като се обобщят обемите на всички отделни и еднократно преброени сделки за дадения финансов инструмент;

в) обемите на търговията, посочени в параграф 1, буква б) и параграф 2, буква б), се определят, като се обобщят обемите на отделните и еднократно преброени сделки за съответния финансов инструмент, отчетени с обозначенията „референтна цена“ и „договорени сделки с ликвидни финансови инструменти“ в съответствие с таблица 4 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/587.

5. Местата на търговия и ДКД обобщават само сделки, изпълнени в една и съща валута, и отчитат отделно всеки обобщен обем във валутата, която е използвана за сделките.

6. Местата на търговия представят на компетентния орган данните, посочени в параграфи 1—5, на първо и шестнадесето число на всеки календарен месец до 13:00 ч. централноевропейско време. Когато първо или шестнадесето число на календарния месец се пада в неработен ден за мястото на търговия, мястото на търговия отчита данните пред компетентния орган до 13:00 ч. централноевропейско време на следващия работен ден.

7. Местата на търговия представят на компетентните органи общите обеми на търговията, определени в съответствие с параграфи 1—5, въз основа на следните периоди:

а) за отчетите, които подлежат на представяне на шестнадесето число всеки календарен месец, периодът на изпълнение е от първо до петнадесето число на същия календарен месец;

б) за отчетите, които подлежат на представяне на първо число всеки календарен месец, периодът на изпълнение е от шестнадесето до последното число на предходния календарен месец.

8. Чрез дерогация от параграфи 6 и 7 местата на търговия представят първия отчет за всеки финансов инструмент на датата на влизане в сила на Директива 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 600/2014, до 13:00 ч. централноевропейско време, като включват обемите на търговията, посочени в параграф 1 за предходната календарна година. За тази цел местата на търговия отчитат отделно за всеки календарен месец следните обеми:

а) обемите на търговия през периода от първо до петнадесето число на всеки календарен месец;

б) обемите на търговия през периода от шестнадесето до последното число на всеки календарен месец.

9. Местата на търговия и ДКД отговарят на всяко *ad hoc* искане от компетентните органи за обема на търговията за целите на изчислението, което трябва да бъде извършено във връзка с мониторинга на използването на режимите на освобождаване за референтна цена и за договорена сделка, до края на следващия работен ден след датата на искането.

Член 7

Изисквания към компетентните органи за докладване пред ЕОЦКП за целите на механизма за праг на обема и задължението за търговия на деривати

1. Компетентните органи предоставят на ЕОЦКП данните, получени от дадено място на търговия или ДКД в съответствие с член 6, до 13:00 ч. централноевропейско време на следващия работен ден след получаването им.

2. Компетентните органи предоставят на ЕОЦКП данните, получени от дадено място на търговия, ОМП или ДКД за целите на определянето дали дериватите са достатъчно ликвидни, както е посочено в член 1, буква з), без безпричинно забавяне и най-късно до три работни дни след получаването на съответните данни.

Член 8

Изисквания към ЕОЦКП за докладване за целите на механизма за праг на обема

1. ЕОЦКП публикува данните за общия обем на търговията с всеки финансов инструмент през предходните 12 месеца и за процентите на търговията при режимите на освобождаване както за договорена сделка, така и за референтна цена, за целия Съюз и за всяко място на търговия през предходните 12 месеца в съответствие с член 5, параграфи 4, 5 и 6 от Регламент (ЕС) № 600/2014, най-късно до 22.00 ч. централноевропейско време на петия работен ден след края на отчетните периоди, посочени в член 6, параграф 6 от настоящия регламент.

2. Посоченото в параграф 1 публикуване е безплатно и в машинночитаем и читаем от човека формат, както е посочено в член 14 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/571 на Комисията [1] и в член 13, параграфи 4 и 5 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/567.

---

[1] Делегиран регламент (ЕС) 2017/571 на Комисията от 2 юни 2016 г. за допълване на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно лицензирането на доставчиците на услуги за докладване на данни, организационните изисквания към тях и публикуването на информация за сделките (вж. стр. 126 от настоящия брой на Официален вестник).

3. Когато даден финансов инструмент се търгува в повече от една валута в целия Съюз, ЕОЦКП конвертира всички обеми в евро по средните обменни курсове, изчислени въз основа на дневните референтни обменни курсове на еврото, публикувани от Европейската централна банка на нейния уебсайт през предходните 12 месеца. Тези конвертирани обеми се използват за изчисляването и публикуването на общия обем на търговията и на процентите на търговията при режимите на освобождаване както за договорена сделка, така и за референтна цена, в целия Съюз и на всяко място на търговия, както е посочено в параграф 1.

Член 9

Влизане в сила и прилагане

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент се прилага от 3 януари 2018 г.

Той е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 13 юни 2016 година.

За Комисията
Председател
Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ

Таблица 1

Таблица със символи за таблица 2

СИМВОЛ	ТИП ДАННИ	ОПРЕДЕЛЕНИЕ
{ALPHANUM-n}	До n буквено-цифрови знака	Поле за свободен текст.
{DECIMAL-n/m}	Десетично число с общо до n цифри, от които до m цифри могат да бъдат цифри след десетичната запетая	Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни стойности: — десетичният знак е „.“ (точка), — пред числото може да има „-“ (минус) за обозначаване на отрицателни числа. Ако е приложимо, стойностите се закръгляват и не се съкращават.
{CURRENCYCODE_3}	3 буквено-цифрови знака	3-буквен код на валутата в съответствие с определеното в ISO 4217 „Кодове за представяне на валута“
{DATEFORMAT}	Формат за дати по ISO 8601	Датите трябва да се представят в следния формат: ГГГГ-ММ-ДД.
{ISIN}	12 буквено-цифрови знака	ISIN код, както е посочено в ISO 6166
{MIC}	4 буквено-цифрови знака	Код за идентификация на пазарите, както е посочено в ISO 10383

Таблица 2

Формати на отчета за целите на механизма за праг на обема

Наименование на полето за данни	Формат
Отчетен период	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} където първата дата е началото на отчетния период, а втората дата е краят на отчетния период.
Идентификационен номер на отчитащия се субект	Когато отчитащият се субект е място на търговия: {MIC} (сегментен MIC или, по целесъобразност, операционен MIC) или {ALPHANUM-50} ако отчитащият се субект е ДКД.
Идентификатор на мястото на търговия	{MIC} (сегментен MIC, когато е приложимо, в противен случай операционен MIC).
Идентификатор на инструмента	{ISIN}
Валута на сделките	{CURRENCYCODE_3}
Общ обем на търговията (по валути)	{DECIMAL-18/5}

Наименование на полето за данни	Формат
Общ обем на търговията при режим на освобождаване за референтна цена, както е определено в член 4, параграф 1, буква а) от РПФИ (по валути)	{DECIMAL-18/5}
Общ обем на търговията при режим на освобождаване за договорени сделки, както е определено в член 4, параграф 1, буква б), подточка i) от РПФИ (по валути)	{DECIMAL-18/5}