NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2017/577

ze dne 13. června 2016,

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se mechanismu objemového stropu a poskytování informací pro účely transparentnosti a jiných výpočtů

(Text s významem pro EHP)

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ([1]), a zejména na čl. 5 odst. 9 a čl. 22 odst. 4 uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

(1) Nařízení (EU) č. 600/2014 vyžaduje, aby příslušné orgány a Evropský orgán pro cenné papíry a trhy (ESMA) provedly značný počet výpočtů za účelem nastavení použitelnosti předobchodního a poobchodního režimu transparentnosti a obchodní povinnosti pro deriváty, jakož i pro určení, zda je investiční podnik systematickým internalizátorem.

(2) Aby bylo možné potřebné výpočty provádět, musí být jak příslušné orgány, tak i orgán ESMA schopny získat spolehlivé a vysoce kvalitní údaje pro každou třídu aktiv, na kterou se nařízení (EU) č. 600/2014 vztahuje. Je tedy nezbytné zlepšit jak dostupnost, tak kvalitu údajů dostupných příslušným orgánům a orgánu ESMA v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ([2]) a nařízením (EU) č. 600/2014 tak, aby klasifikace finančních nástrojů včetně prahových hodnot pro účely předobchodní a poobchodní transparentnosti a, pokud je to nezbytné, úpravy těchto prahových hodnot mohly být vypočteny na více informovaném základě poté, co byl režim po určitou dobu uplatňován.

(3) Měla by být přijata ustanovení upřesňující v obecné rovině společné prvky týkající se obsahu a formátu údajů, které mají být pro účely transparentnosti a jiných výpočtů předkládány obchodními systémy, schválenými systémy pro uveřejňování informací a poskytovateli konsolidovaných obchodních informací. Tato ustanovení je třeba číst ve spojení s nařízeními Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ([3]), (EU) 2017/583 ([4]), (EU) 2017/567 ([5]), (EU) 2017/565 ([6]) a (EU) 2016/2020 ([7]), která popisují metodiku a údaje potřebné k provedení příslušných výpočtů a upřesňují obsah a rozsah údajů potřebných k provedení výpočtů transparentnosti. Proto by

([1]) Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84.

([2]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně směrnic 2002/92/ES a 2011/61/EU (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

([3]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s akciemi, cennými papíry nahrazujícími jiné cenné papíry, fondy obchodovanými v obchodním systému, certifikáty a jinými podobnými finančními nástroji a regulační technické normy týkající se povinnosti provádět obchody s určitými akciemi v obchodním systému nebo prostřednictvím systematického internalizátora (viz strana 387 v tomto čísle Úředního věstníku).

([4]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty (viz strana 229 v tomto čísle Úředního věstníku).

([5]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/567 ze dne 18. května 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o definice, transparentnost, kompresi portfolia a dohledová opatření v oblasti zásahů u produktů a pozic (viz strana 90 v tomto čísle Úředního věstníku).

([6]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/565 ze dne 25. dubna 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o organizační požadavky a provozní podmínky investičních podniků a o vymezení pojmů pro účely zmíněné směrnice (viz strana 1 v tomto čísle Úředního věstníku).

([7]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2016/2020 ze dne 26. května 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy pro kritéria k určení toho, zda by deriváty podléhající povinnosti clearingu měly podléhat obchodní povinnosti (Úř. věst. L 313, 19.11.2016, s. 2).

měl být při provádění těchto výpočtů obsah, formát a kvalita údajů předložených ve vztahu k obchodním systémům, schváleným systémům pro uveřejňování informací a poskytovatelům konsolidovaných obchodních informací v souladu s platnou metodikou stanovenou příslušnými prováděcími akty směrnice 2014/65/EU a nařízení (EU) č. 600/2014.

(4) S výjimkou případných ad hoc žádostí o údaje a výpočtů, které mají být provedeny pro účely mechanismu objemového stropu, by měly obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací předkládat zprávy denně. S ohledem na široký rozsah pokrytých finančních nástrojů a velké množství údajů, které mají být zpracovány, umožňuje toto denní hlášení příslušným orgánům přesněji zpracovávat soubory zvládnutelných velikostí a zajišťuje efektivní a včasnou organizaci předkládání údajů, kontrolu jejich kvality a zpracování. Každodenní sběr údajů také zjednodušuje plnění povinnosti obchodních systémů, schválených systémů pro uveřejňování informací a poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací poskytovat údaje odstraněním zátěže, kterou představuje potřeba vypočítávat obchodní dny v případech, na které se vztahuje toto kvantitativní kritérium likvidity, a shromažďovat údaje týkající se stejných finančních nástrojů napříč různými koši splatnosti v případech, kde je třeba vzít v úvahu dobu splatnosti. Centralizace výpočtů také zajišťuje jednotné používání kritérií napříč finančními instrumenty a obchodními systémy.

(5) Obchodní systémy by měly uchovávat údaje, které budou komplexní a umožní příslušným orgánům a orgánu ESMA provádět přesné výpočty. Zatímco vyžadované informace jsou obvykle uvedeny v poobchodních zprávách, v některých případech přesahují informace nezbytné pro provádění výpočtů rámec informací dostupných v těchto zprávách. To zahrnuje například informace o obchodech provedených na základě pokynů, které využívají výjimky z důvodu velkého rozsahu. Tyto informace by neměly být zahrnuty do obchodních zpráv, jelikož by mohly vystavit takovéto obchody nepříznivým tržním dopadům. Nicméně, tyto informace mohou být nezbytné k tomu, aby příslušné orgány mohly provádět přesné výpočty, a měly by proto být obchodními systémy, schválenými systémy pro uveřejňování informací a poskytovateli konsolidovaných obchodních informací náležitě uchovávány a v případě potřeby sděleny příslušným orgánům a orgánu ESMA. Obchodní systémy by měly zaručit, že informace, které mají být poskytnuty příslušným orgánům a orgánu ESMA, budou předávány vhodným způsobem. Obchody, které jsou prováděny na základě pokynů velkého rozsahu, by měly být v jejich zprávách pro poskytovatele konsolidovaných obchodních informací řádně označeny.

(6) Údaje by měly být shromažďovány z různých zdrojů, protože jednotlivé zdroje nemusí vždy obsahovat kompletní soubor údajů pro danou třídu aktiv, nebo dokonce ani pro určitý nástroj. K tomu, aby mohly příslušné orgány a orgán ESMA získat a konsolidovat vysoce kvalitní údaje z různých zdrojů, by měly obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací používat přednastavené parametry pro obsah a formát tam, kde jsou k dispozici, aby byl sběr údajů jednodušší a nákladově efektivnější.

(7) Vzhledem k citlivosti nezbytných výpočtů a možným obchodním důsledkům, jaké by pro obchodní systémy, emitenty a další účastníky trhu mělo uveřejnění nesprávných informací, které by mohlo v případě mechanismu objemového stropu vést k pozastavení využívání výjimek pro určitý obchodní systém nebo pro určitý finanční nástroj v celé Unii, je zásadní objasnit formát údajů, které mají být předkládány příslušným orgánům a orgánu ESMA, za účelem zřízení účinných komunikačních kanálů s obchodními systémy a poskytovateli konsolidovaných obchodních informací a zajištění včasného a správného uveřejnění vyžadovaných údajů.

(8) Nařízení (EU) č. 600/2014 vyžaduje, aby orgán ESMA ve vztahu k finančním nástrojům, na které se vztahuje mechanismus objemového stropu, uveřejnil vyčíslení celkového objemu obchodování za předcházejících 12 měsíců a procentní podíl obchodování realizovaného v rámci výjimky pro sjednané obchody a výjimky vztahující se k referenční ceně v celé Unii a v jednotlivých obchodních systémech za předcházejících 12 měsíců. V případě finančních nástrojů, s nimiž se obchoduje ve více než jedné měně, je nutné převést objemy provedené v různých měnách na jednu společnou měnu tak, aby bylo možné provést přepočet těchto objemů a vyžadované výpočty. Proto by měla být stanovena metodika a směnné kurzy pro použití k převodu objemů obchodů tam, kde je to nutné.

(9) Pro účely mechanismu objemového stropu by měly mít obchodní systémy povinnost hlásit objemy obchodů realizovaných v rámci výjimky vztahující se k referenční ceně a v případě likvidních nástrojů výjimky pro sjednané obchody. Vzhledem k tomu, že se tyto výjimky vztahují na pokyny, a nikoli na obchody, je důležité vyjasnit, že hlášené objemy by měly zahrnovat veškeré obchody označené jako „RFTP“ nebo „NLIQ“ pro účely poobchodního uveřejnění a jak je upřesněno v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587. Pokud byl obchod proveden na základě dvou pokynů využívajících výjimky z důvodu velkého rozsahu, neměl by se tento obchod započítávat do objemu vypočteného v rámci výjimky vztahující se k referenční ceně a výjimky pro sjednané obchody.

(10) Pro účely mechanismu objemového stropu by měly obchodní systémy a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací zaručit dostatečně podrobnou identifikaci obchodního systému, ve kterém byl obchod

proveden, aby orgán ESMA mohl provést veškeré výpočty stanovené v nařízení (EU) č. 600/2014. Zejména identifikační označení použité pro obchodní systém by mělo být jedinečné pro daný obchodní systém a nemělo by být sdíleno s žádným jiným obchodním systémem provozovaným stejným organizátorem trhu. Identifikační označení obchodního systému by mělo orgánu ESMA umožnit, aby jednoznačně rozlišil veškeré obchodní systémy, pro které daný organizátor trhu obdržel zvláštní povolení podle směrnice 2014/65/EU.

(11) Pro účely mechanismu objemového stropu je nutné požadovat, aby v den, kdy vstoupí v použitelnost směrnice 2014/65/EU a nařízení (EU) č. 600/2014, obchodní systémy předložily svou první zprávu obsahující objemy obchodů za předcházející kalendářní rok v rámci výjimky vztahující se k referenční ceně a pro likvidní finanční nástroje v rámci výjimky pro sjednané obchody. Aby bylo zajištěno přiměřené uplatňování tohoto požadavku, měly by obchodní systémy za tímto účelem založit svou zprávu na upravených objemech obchodů provedených v rámci odpovídajících výjimek stanovených směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES ([1]) a nařízení Komise (ES) č. 1287/2006 ([2]).

(12) S cílem poskytnout příslušným orgánům a orgánu ESMA přesné údaje by měly obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací zajistit, aby byly obchody v jejich zprávách započítány pouze jednou.

(13) Ustanovení tohoto nařízení jsou úzce spjata, neboť se zabývají upřesněním obsahu, četnosti a formátu žádostí o údaje, metody použité pro zpracování těchto údajů a dalších požadavků týkajících se uveřejnění informací pro účely transparentnosti, jak stanoví nařízení (EU) č. 600/2014. Pro zajištění soudržnosti mezi těmito ustanoveními, která vstoupí v platnost současně, a pro poskytnutí uceleného přehledu zúčastněným stranám, a to zejména těm, které podléhají těmto povinnostem, je žádoucí, aby ustanovení byla zahrnuta do jednoho nařízení.

(14) Z důvodu konzistentnosti a pro zajištění hladkého fungování finančních trhů je nezbytné, aby se ustanovení tohoto nařízení a ustanovení nařízení (EU) č. 600/2014 použila od stejného data.

(15) Toto nařízení vychází z návrhů regulačních technických norem předložených Komisi orgánem ESMA.

(16) Orgán ESMA uspořádal otevřené veřejné konzultace o návrzích regulačních technických norem, z nichž toto nařízení vychází, provedl analýzu potenciálních souvisejících nákladů a přínosů a vyžádal si stanovisko skupiny subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů, zřízené na základě článku 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ([3]),

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Předmět a oblast působnosti

1. Toto nařízení stanoví podrobnosti týkající se žádostí o údaje zasílaných příslušnými orgány a podrobnosti týkající se odpovědí na tyto žádosti zasílaných obchodními systémy, schválenými systémy pro uveřejňování informací a poskytovateli konsolidovaných obchodních informací pro účely výpočtů a úprav režimů předobchodní a poobchodní transparentnosti a obchodní povinnosti, a to zejména pro účely stanovení těchto faktorů:

a) zda pro kapitálové, obdobné a nekapitálové finanční nástroje existuje likvidní trh;

b) prahové hodnoty pro výjimky z předobchodní transparentnosti pro kapitálové, obdobné a nekapitálové finanční nástroje;

([1]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES ze dne 21. dubna 2004 o trzích finančních nástrojů, o změně směrnice Rady 85/611/EHS a 93/6/EHS a směrnice Evropského parlamentu a Rady 2000/12/ES a o zrušení směrnice Rady 93/22/EHS (Úř. věst. L 145, 30.4.2004, s. 1).

([2]) Nařízení Komise (ES) č. 1287/2006 ze dne 10. srpna 2006, kterým se provádí směrnice Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES, pokud jde o evidenční povinnosti investičních podniků, hlášení obchodů, transparentnost trhu, přijímání finančních nástrojů k obchodování a o vymezení pojmů pro účely zmíněné směrnice (Úř. věst. L 241, 2.9.2006, s. 1).

([3]) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

c) prahové hodnoty pro odklad poobchodní transparentnosti pro kapitálové, obdobné a nekapitálové finanční nástroje;

d) kdy likvidita třídy finančních nástrojů klesne pod stanovenou prahovou hodnotu;

e) zda je investiční podnik systematickým internalizátorem;

f) standardní tržní objem platný pro systematické internalizátory při obchodech s kapitálovými či obdobnými nástroji a konkrétní objem pro daný nástroj platný pro systematické internalizátory při obchodech s nekapitálovými nástroji;

g) u kapitálových a obdobných nástrojů celkový objem obchodování za předcházejících 12 měsíců a procentní podíl obchodování realizovaného v rámci výjimky pro sjednané obchody a výjimky vztahující se k referenční ceně v celé Unii a v jednotlivých obchodních systémech za předcházejících 12 měsíců;

h) zda jsou deriváty dostatečně likvidní pro účely plnění obchodní povinnosti pro deriváty.

Článek 2

Obsah žádostí o údaje a informace, které mají být hlášeny

1. Za účelem provádění výpočtů v předem stanovených termínech nebo s předem stanovenou četností poskytnou obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací příslušným orgánům veškeré údaje vyžadované k provedení výpočtů stanovených v těchto nařízeních:

a) nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587;

b) nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583;

c) nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/567;

d) nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/565.

2. Příslušné orgány mohou v případě potřeby požadovat od obchodních systémů, schválených systémů pro uveřejňování informací a poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací dodatečné informace pro účely sledování a úpravy prahových hodnot a parametrů uvedených v čl. 1 písm. a) až f) a h).

3. Příslušné orgány mohou požadovat veškeré údaje, které orgán ESMA musí zvážit podle nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2016/2020 v případě nekapitálových finančních nástrojů, včetně údajů o těchto skutečnostech:

a) průměrná frekvence obchodů;

b) průměrný objem a rozložení obchodů;

c) počet a typ účastníků trhu;

d) průměrná velikost rozpětí.

Článek 3

Četnost žádostí o údaje a lhůty pro odpověď obchodních systémů, schválených systémů pro uveřejňování informací a poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací

1. Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací předkládají údaje uvedené v čl. 2 odst. 1 každý den.

2. Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací předloží údaje v reakci na žádost ad hoc, jak je uvedeno v čl. 2 odst. 2, během čtyř týdnů od obdržení této žádosti, pokud mimořádné okolnosti nevyžadují odpověď v kratším termínu uvedeném v žádosti.

3. Odchylně od odstavců 1 a 2 předloží obchodní systémy a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací údaje, které mají být využity pro účely mechanismu objemového stropu, ve lhůtách stanovených v čl. 6 odst. 6 až 9.

Článek 4

Formát žádostí o údaje

Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací předloží údaje uvedené v článku 2 v jednotném formátu XML a, jsou-li k dispozici, v souladu s dalšími požadavky na obsah a formát definovanými s cílem zajistit účinný a automatizovaný proces poskytování údajů, jakož i jejich konsolidace s podobnými údaji z jiných zdrojů.

Článek 5

Druhy údajů, které musí být uchovány, a minimální doba, po kterou obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací údaje uchovávají

1. Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací uchovávají veškeré údaje potřebné pro výpočet, sledování či úpravu prahových hodnot a parametrů stanovených v článku 2, a to bez ohledu na to, jestli byly tyto informace uveřejněny, či nikoli.

2. Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací uchovávají údaje uvedené v odstavci 1 po dobu nejméně tří let.

Článek 6

Požadavky na hlášení pro obchodní systémy a poskytovatele konsolidovaných obchodních informací pro účely mechanismu objemového stropu

1. Pro každý finanční nástroj, na který se vztahují požadavky na transparentnost stanovené v článku 3 nařízení (EU) č. 600/2014, předloží obchodní systémy příslušnému orgánu tyto údaje:

a) celkový objem obchodování s daným finančním nástrojem provedeného v daném obchodním systému;

b) celkové objemy obchodování s daným finančním nástrojem provedeného v daném obchodním systému v rámci výjimky podle čl. 4 odst. 1 písm. a) nebo čl. 4 odst. 1 písm. b) bodu i) nařízení (EU) č. 600/2014, přičemž se celkové objemy hlásí pro každou výjimku samostatně.

2. Pro každý finanční nástroj, na který se vztahují požadavky na transparentnost stanovené v článku 3 nařízení (EU) č. 600/2014, a pokud o to požádá příslušný orgán, předloží poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací příslušnému orgánu tyto údaje:

a) celkové objemy obchodování s daným finančním nástrojem provedeného ve všech obchodních systémech v Unii, přičemž se celkové objemy hlásí pro každý obchodní systém samostatně;

b) celkové objemy obchodování provedeného ve všech obchodních systémech v Unii v rámci výjimky podle čl. 4 odst. 1 písm. a) nebo čl. 4 odst. 1 písm. b) bodu i) nařízení (EU) č. 600/2014, přičemž se celkové objemy hlásí pro každou výjimku a každý obchodní systém samostatně.

3. Obchodní systémy a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací hlásí údaje stanovené v odstavcích 1 a 2 příslušnému orgánu za použití formátů uvedených v příloze. Zejména zajistí, aby poskytnutá identifikační označení obchodního systému byla dostatečně podrobná, aby příslušné orgány a orgán ESMA mohly určit objemy obchodování provedeného v rámci výjimky vztahující se k referenční ceně a v případě likvidních finančních nástrojů výjimky pro sjednané obchody v každém obchodním systému a aby bylo možné provést výpočet podílu dle čl. 5 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014.

4. Pro účely výpočtu objemů uvedených v odstavcích 1 a 2:

a) objem jednotlivého obchodu se určí vynásobením ceny finančního nástroje počtem obchodovaných jednotek;

b) celkový objem obchodování s určitým finančním nástrojem uvedený v odst. 1 písm. a) a odst. 2 písm. a) se určí součtem objemů všech jednotlivých, jednou započítaných obchodů s daným finančním nástrojem;

c) objemy obchodování uvedené v odst. 1 písm. b) a odst. 2 písm. b) se určí součtem objemů jednotlivých, jednou započítaných obchodů s daným finančním nástrojem, které jsou označeny jako „referenční cena“ a „sjednané obchody s likvidními finančními nástroji“ v souladu s tabulkou 4 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587.

5. Obchodní systémy a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací sečtou pouze obchody provedené ve stejné měně a předloží hlášení samostatně o každém souhrnném objemu v měně použité pro obchody.

6. Obchodní systémy předloží příslušnému orgánu údaje uvedené v odstavcích 1 až 5 první a šestnáctý den každého kalendářního měsíce do 13:00 SEČ. V případě, že první nebo šestnáctý den v kalendářním měsíci není pro daný obchodní systém dnem pracovním, obchodní systém předloží údaje příslušnému orgánu do 13:00 SEČ následujícího pracovního dne.

7. Obchodní systémy předloží příslušnému orgánu celkové objemy obchodování stanovené v souladu s odstavci 1 až 5 za tato období:

a) zprávy, které mají být předloženy šestnáctý den každého kalendářního měsíce, zahrnují obchody provedené mezi prvním a patnáctým dnem téhož kalendářního měsíce;

b) zprávy, které mají být předloženy první den každého kalendářního měsíce, zahrnují obchody provedené mezi šestnáctým a posledním dnem předcházejícího kalendářního měsíce.

8. Odchylně od odstavců 6 a 7 předloží obchodní systémy první zprávu ke každému finančními nástroji v den, kdy vstoupí v použitelnost směrnice 2014/65/EU a nařízení (EU) č. 600/2014, a to nejpozději do 13:00 SEČ, přičemž tato zpráva bude zahrnovat objemy obchodování uvedené v odstavci 1 za předcházející kalendářní rok. Za tímto účelem předloží obchodní systémy za každý kalendářní měsíc samostatné hlášení o:

a) objemech obchodování během prvního až patnáctého dne každého kalendářního měsíce;

b) objemech obchodování během šestnáctého až posledního dne každého kalendářního měsíce.

9. Obchodní systémy a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací odpoví na jakoukoli žádost *ad hoc* příslušných orgánů týkající se objemu obchodování ve vztahu k výpočtům, které mají být provedeny pro účely sledování využívání výjimky vztahující se k referenční ceně nebo výjimky pro sjednané obchody, a to do konce následujícího pracovního dne po obdržení žádosti.

Článek 7

Požadavky na hlášení pro příslušné orgány při předkládání hlášení orgánu ESMA pro účely mechanismu objemového stropu a obchodní povinnosti pro deriváty

1. Příslušné orgány poskytnou orgánu ESMA údaje získané od obchodních systémů nebo poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací v souladu s článkem 6 do 13:00 SEČ následujícího pracovního dne po jejich obdržení.

2. Příslušné orgány poskytnou orgánu ESMA údaje získané od obchodních systémů, schválených systémů pro uveřejňování informací nebo poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací za účelem určení, zda jsou deriváty dostatečně likvidní, jak stanoví čl. 1 písm. h), bez zbytečného odkladu, nejpozději však do tří pracovních dní od obdržení příslušných údajů.

Článek 8

Požadavky na hlášení pro orgán ESMA pro účely mechanismu objemového stropu

1. Orgán ESMA uveřejní vyčíslení celkového objemu obchodování s každým finančním nástrojem za předcházejících 12 měsíců a procentní podíl obchodování provedeného v rámci výjimky pro sjednané obchody a výjimky vztahující se k referenční ceně v celé Unii a v jednotlivých obchodních systémech za předcházejících 12 měsíců v souladu s čl. 5 odst. 4, 5 a 6 nařízení (EU) č. 600/2014, a to nejpozději do 22:00 SEČ pátého pracovního dne následujícího po konci vykazovaného období stanoveného v čl. 6 odst. 6 tohoto nařízení.

2. Uveřejnění uvedené v odstavci 1 nebude zpoplatněné a bude dostupné ve strojově i okem čitelném formátu, jak stanoví článek 14 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/571 ([1]) a čl. 13 odst. 4 a 5 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/567.

([1]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/571 ze dne 2. června 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o regulační technické normy týkající se povolování, organizačních požadavků a uveřejňování obchodů pro poskytovatele služeb hlášení údajů (viz strana 126 v tomto čísle Úředního věstníku).

3. Pokud se s finančním nástrojem obchoduje v celé Unii ve více než jedné měně, orgán ESMA převede veškeré objemy na eura za použití průměrných směnných kurzů vypočtených na základě denních referenčních směnných kurzů eura uveřejněných Evropskou centrální bankou na jejích internetových stránkách v předcházejících 12 měsících. Tyto převedené objemy budou použity pro výpočet a uveřejnění celkového objemu obchodování a procentního podílu obchodování provedeného v rámci výjimky pro sjednané obchody a výjimky vztahující se k referenční ceně v celé Unii a v jednotlivých obchodních systémech, jak je uvedeno v odstavci 1.

Článek 9

Vstup v platnost a použitelnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Použije se od 3. ledna 2018.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 13. června 2016.

Za Komisi
předseda
Jean-Claude JUNCKER

PŘÍLOHA

Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
{ALPHANUM-n}	Až *n* alfanumerických znaků	Volný text
{DECIMAL-n/m}	Celkem až *n*místné desetinné číslo, z čehož až *m* míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. — desetinný oddělovač je „.“ (tečka); — před číslem může být znaménko „–“ (mínus) pro označení záporných čísel. Hodnoty se případně zaokrouhlují, nikoli zkracují.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217
{DATEFORMAT}	Datum ve formátu podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383

Tabulka 2

Formát zpráv pro účely mechanismu objemového stropu

Název datového pole	Formát
Vykazované období	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} kde první datum označuje začátek vykazovaného období a druhé datum jeho konec.
Identifikace vykazujícího subjektu	Pokud je vykazujícím subjektem obchodní systém: {MIC} (MIC tržního segmentu nebo případně operační MIC) nebo {ALPHANUM-50} pokud je vykazujícím subjektem poskytovatel konsolidovaných obchodních informací.
Identifikační kód obchodního systému	{MIC} (MIC tržního segmentu nebo případně operační MIC)
Identifikační kód nástroje	{ISIN}
Měna obchodování	{CURRENCYCODE_3}
Celkový objem obchodování (pro danou měnu)	(DECIMAL-18/5)

Název datového pole	Formát
Celkový objem obchodování v rámci výjimky vztahující se k referenční ceně ve smyslu čl. 4 odst. 1 písm. a) nařízení MiFIR (pro danou měnu)	(DECIMAL-18/5)
Celkový objem obchodování v rámci výjimky pro sjednané obchody ve smyslu čl. 4 odst. 1 písm. b) bodu i) nařízení MiFIR (pro danou měnu)	(DECIMAL-18/5)