A BIZOTTSÁG (EU) 2017/577 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2016. június 13.)

a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a volumenkorlátozási mechanizmusra, továbbá az átláthatósági és egyéb számítások céljából történő információszolgáltatásra vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG,

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló, 2014. május 15-i 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre [1] és különösen annak 5. cikke (9) bekezdésére és 22. cikke (4) bekezdésére,

mivel:

(1) A 600/2014/EU rendelet értelmében az illetékes hatóságoknak és az Európai Értékpapír-piaci Hatóságnak (ESMA) jelentős számú számítást kell végeznie annak érdekében, hogy kalibrálja a kereskedés előtti és a kereskedés utáni átláthatóságra vonatkozó szabályok alkalmazhatóságát, a származtatott termékekre vonatkozó kereskedési kötelezettséget, továbbá meghatározza, hogy a befektetési vállalkozás mikor minősül rendszeres internalizálónak.

(2) A szükséges számítások elvégzése érdekében az illetékes hatóságoknak és az ESMA-nak is képesnek kell lennie arra, hogy megbízható és magas színvonalú adatokat kapjanak a 600/2014/EU rendelet hatályába tartozó minden egyes eszközosztály tekintetében. Szükséges ezért javítani az illetékes hatóságok és az ESMA számára a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek [2] és a 600/2014/EU rendeletnek megfelelően rendelkezésre álló adatok hozzáférhetőségét és egyúttal színvonalát, hogy a pénzügyi eszközök besorolása – és egyben a kereskedés előtti és a kereskedés utáni átláthatóságra vonatkozó küszöbértékek számítása, illetve szükség esetén e küszöbértékek újrakalibrálása – tájékozottabb alapon történhessen, a szabályok egy bizonyos ideig tartó alkalmazása után.

(3) Meg kell állapítani azon rendelkezéseket, amelyek általánosan meghatározzák a kereskedési helyszínek, jóváhagyott közzétételi mechanizmusok (APA-k) és összesítettadat-szolgáltatók (CTP-k) által az átláthatósági és egyéb számítások céljából rendelkezésre bocsátandó adatok közös tartalmi és formai elemeit. Ezeket a rendelkezéseket az (EU) 2017/587 [3], az (EU) 2017/583 [4], az (EU) 2017/567 [5], az (EU) 2017/565 [6] és az (EU) 2016/2020 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelettel [7] összefüggésben kell olvasni, amelyek a vonatkozó számítások elvégzéséhez szükséges módszertant és adatokat ismertetik, továbbá meghatározzák az átláthatósági

[1] HL L 173., 2014.6.12., 84. o.

[2] Az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 2014/65/EU irányelve a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 349. o.).

[3] A Bizottság 2016. július 14-i (EU) 2017/587 felhatalmazáson alapuló rendelete a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a részvényekkel, letéti jegyekkel, tőzsdén kereskedett alapokkal, certifikátokkal és más hasonló pénzügyi eszközökkel kapcsolatos, kereskedési helyszínekre és befektetési vállalkozásokra vonatkozó átláthatósági követelményeket és bizonyos részvények ügyleteinek kereskedési helyszínen vagy rendszeres internalizálónál való végrehajtására irányuló kötelezettséget meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 387. oldalát).

[4] A Bizottság 2016. július 14-i (EU) 2017/583 felhatalmazáson alapuló rendelete a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a kötvényekkel, strukturált pénzügyi eszközökkel, kibocsátási egységekkel és származtatott termékekkel kapcsolatos, kereskedési helyszínekre és befektetési vállalkozásokra vonatkozó átláthatósági követelményeket meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 229. oldalát).

[5] A Bizottság 2016. május 18-i (EU) 2017/567 felhatalmazáson alapuló rendelete az 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet fogalommeghatározások, átláthatóság, származtatott termékek, portfóliótömörítés és a termékszintű beavatkozással és a pozíciómenedzsmenttel kapcsolatos felügyeleti intézkedések tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 90. oldalát).

[6] A Bizottság 2016. április 25-i (EU) 2017/565 felhatalmazáson alapuló rendelete a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek a befektetési vállalkozások szervezeti követelményei és működési feltételei, valamint az irányelv alkalmazásában meghatározott kifejezések tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 1. oldalát).

[7] A Bizottság 2016. május 26-i (EU) 2016/2020 felhatalmazáson alapuló rendelete a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az elszámolási kötelezettség hatálya alá tartozó származtatott termékek kereskedési kötelezettség hatálya alá vonásának megállapítására vonatkozó kritériumokat meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 313., 2016.11.19., 2. o.).

számítások elvégzéséhez szükséges adatok tartalmát és körét. Következésképpen az ilyen számítások elvégzésekor a kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k által benyújtott adatok tartalmának, formátumának és színvonalának összhangban kell lennie a 2014/65/EU irányelv és a 600/2014/EU rendelet vonatkozó végrehajtási aktusaiban előírt alkalmazandó módszertannal.

(4) A potenciális eseti adatkérések és a volumenkorlátozási mechanizmus céljából elvégzendő számítások kivételével a kereskedési helyszíneknek, APA-knak és CTP-knek napi rendszerességgel kell adatot szolgáltatniuk. A lefedett pénzügyi eszközök széles körére és a feldolgozandó adatok nagy mennyiségére tekintettel a napi adatszolgáltatás révén az illetékes hatóságok precízebben tudják feldolgozni a kezelhető méretű állományokat, továbbá hatékonyabban és időben tudják elvégezni az adatszolgáltatással, az adatszínvonal-ellenőrzéssel és az adatfeldolgozással kapcsolatos feladatokat. Az adatok napi szintű gyűjtése emellett egyszerűsíti a kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k adatszolgáltatási kötelezettségeit is, mivel megszabadítja azokat a kereskedési napok számításának terhétől azokban az esetekben, amikor a mennyiségi likviditási kritériumot kell alkalmazni, illetve az adott pénzügyi eszköz különböző lejárati csoportok szerinti adatainak összesítésével járó terhektől azokban az esetekben, amikor a lejáratig hátralévő időt kell figyelembe venni. E számítás központosítása biztosítja a kritériumok pénzügyi eszközök és kereskedési helyszínek közötti egységes alkalmazását is.

(5) A kereskedési helyszíneknek olyan átfogó adatokat kell tárolniuk, amelyek az illetékes hatóságok és az ESMA számára lehetővé teszik precíz számítások elvégzését. Az előírt információk általában megtalálhatók a kereskedés utáni adatszolgáltatásban, de a számításokhoz az ilyen adatszolgáltatással rendelkezésre álló információknál több információ szükséges. Ilyen például az olyan megbízások alapján végrehajtott ügyletekre vonatkozó információ, amelyek nagyságrend miatti mentességet élveznek. Ezt az információt nem szabad feltüntetni a kereskedési adatszolgáltatásban, mivel ez hátrányos piaci hatásnak tehetné ki a szóban forgó ügyleteket. Mivel azonban az ilyen információ szükséges lehet ahhoz, hogy az illetékes hatóságok precíz számításokat végezzenek, azt a kereskedési helyszíneknek, az APA-knak és a CTP-knek megfelelően tárolniuk kell, illetve szükség esetén kommunikálniuk kell az illetékes hatóságok és az ESMA felé. A kereskedési helyszíneknek biztosítaniuk kell, hogy megfelelően terjesszék az illetékes hatóságok és az ESMA rendelkezésére bocsátandó információkat. A nagy nagyságrendű megbízások alapján végrehajtott ügyleteket megfelelően azonosítani kell a CTP-knek szánt adatszolgáltatásban.

(6) Az adatokat különböző forrásokból kell begyűjteni, mivel előfordulhat, hogy egyetlen forrás nem rendelkezik az adott eszközosztályra vagy akár a konkrét eszközre vonatkozó összes adattal. Ezért annak érdekében, hogy az illetékes hatóságok és az ESMA különböző forrásokból juthassanak a konszolidálandó magas színvonalú adatokhoz, a kereskedési helyszíneknek, az APA-knak és a CTP-knek, ha az rendelkezésre áll, a tartalom és a formátum tekintetében előre meghatározott specifikáció használatával elő kell segíteniük az adatgyűjtés könnyebb és költséghatékonyabb lebonyolítását.

(7) Figyelembe véve a szükséges számítások érzékenységét és azt, hogy a helytelen információk közzététele gazdasági következményekkel járhat a kereskedési helyszínek, kibocsátók és más piaci szereplők számára, illetve a volumenkorlátozási mechanizmus révén a mentességek alkalmazásának felfüggesztését okozhatja egy adott helyszínen vagy egy adott pénzügyi eszköz vonatkozásában az Unió egész területén, alapvetően fontos pontosítani az illetékes hatóságok és az ESMA számára szolgáltatandó adatok formátumát annak érdekében, hogy hatékony kommunikációs csatornákat hozzanak létre a kereskedési helyszínek és CTP-k felé, és biztosítsák az előírt adatok kellő időben történő és helyes közzétételét.

(8) A 600/2014/EU rendelet szerint az ESMA-nak a volumenkorlátozási mechanizmus hatályába tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában közzé kell tennie az előző 12 havi kereskedés összvolumenét és azt, hogy az előre letárgyalt kereskedéssel és a referenciaárral kapcsolatos mentességek alkalmazása mellett folyó kereskedés az Unió egész területe és az egyes kereskedési helyszínek vonatkozásában mekkora százalékos arányt tesz ki az előző 12 hónapban. Az egynél több pénznemben kereskedett pénzügyi eszközök esetében a különböző pénznemben végrehajtott volumeneket azok összesítése és az előírt számítások elvégzése érdekében át kell számítani egy közös pénznemre. Következésképpen rendelkezni kell a kereskedési volumenek adott esetben szükséges konverziójához használt módszertanról és árfolyamokról.

(9) A volumenkorlátozási mechanizmus keretében a kereskedési helyszínek számára elő kell írni, hogy adatot szolgáltassanak a referenciaárral kapcsolatos és – likvid eszközök vonatkozásában – az előre letárgyalt kereskedéssel kapcsolatos mentesség keretében végrehajtott kereskedés volumeneiről. Mivel a mentességek nem ügyletekre, hanem megbízásokra vonatkoznak, fontos pontosítani, hogy a jelentendő volumeneknek magukban kell foglalniuk az ügyletek kereskedés utáni közzététele céljából az (EU) 2017/587 felhatalmazáson alapuló rendeletnek megfelelően „RFPT" vagy „NLIQ" kóddal jelölt ügyleteket. Ha egy ügyletet két, nagyságrend miatti mentességet élvező megbízás alapján hajtották végre, akkor az ügylet nem számítható bele a referenciaárral kapcsolatos és az előre letárgyalt kereskedéssel kapcsolatos mentesség keretében számított volumenekbe.

(10) A volumenkorlátozási mechanizmus keretében a kereskedési helyszíneknek és a CTP-knek biztosítaniuk kell, hogy az ügylet végrehajtásának kereskedési helyszíne kellő részletességgel azonosítva legyen ahhoz, hogy az ESMA el

tudja végezni a 600/2014/EU rendeletben említett számításokat. Különösen az alkalmazott kereskedésihelyszín-azonosítónak kell az adott kereskedési helyszín tekintetében egyedinek lennie, vagyis nem lehet közös az ugyanazon piacműködtető által működtetett más kereskedési helyszínével. A kereskedésihelyszín-azonosítóknak lehetővé kell tenniük, hogy az ESMA egyértelmű módon meg tudja különböztetni mindazon kereskedési helyszíneket, amelyek tekintetében a piacműködtető a 2014/65/EU irányelv szerinti külön engedélyt kapott.

(11) A volumenkorlátozási mechanizmus keretében szükséges előírni, hogy a kereskedési helyszínek az első adatszolgáltatást az előző naptári évre vonatkozóan a 2014/65/EU irányelv és a 600/2014/EU rendelet hatálybalépése napján nyújtsák be a referenciaárral kapcsolatos és – a likvid pénzügyi eszközök esetében – az előre letárgyalt kereskedéssel kapcsolatos mentesség szerinti kereskedési volumenek tekintetében. E követelmény arányos alkalmazása érdekében a kereskedési helyszíneknek az adatszolgáltatást e célból a 2004/39/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv ([1]) és az 1287/2006/EK bizottsági rendelet ([2]) szerinti hatályos egyenértékű mentességek keretében végrehajtott kereskedés kiigazított volumenei alapján kell elvégezniük.

(12) Az illetékes hatóságok és az ESMA pontos adatokkal való ellátása érdekében a kereskedési helyszíneknek, az APA-knak és a CTP-knek biztosítaniuk kell, hogy adatszolgáltatásaikban az ügyleteket csak egyszer vegyék számításba.

(13) E rendelet rendelkezései szorosan kapcsolódnak egymáshoz, mivel az adatkérések tartalmát, gyakoriságát és formátumát, az ezen adatok feldolgozásához használandó módszert és a 600/2014/EU rendeletben meghatározott átláthatósági célokat szolgáló egyéb közzétételi előírásokat határozzák meg. Ezen egyidejűleg hatályba lépő rendelkezések koherenciája, valamint annak elősegítése érdekében, hogy az érdekeltek – különösen az említett kötelezettségek hatálya alá tartozó személyek – átfogó rálátással rendelkezzenek, célszerű e rendelkezéseket egyetlen rendeletbe foglalni.

(14) A következetesség és a pénzügyi piacok zavartalan működése érdekében az e rendeletben megállapított rendelkezéseket és a 600/2014/EU rendelet rendelkezéseit azonos időponttól kell alkalmazni.

(15) Ez a rendelet az ESMA által a Bizottsághoz benyújtott szabályozástechnikai standardtervezeteken alapul.

(16) Az ESMA nyilvános konzultációt folytatott az e rendelet alapját képező szabályozástechnikai standardtervezetekről, elemezte az ezekkel összefüggésben felmerülő esetleges költségeket és hasznot, és kikérte az 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet ([3]) 37. cikke alapján létrehozott Értékpapír-piaci Érdekképviseleti Csoport véleményét,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

1. cikk

Tárgy és hatály

(1) Ez a rendelet az illetékes hatóságok által küldendő adatkérések, illetve a kereskedési helyszínek, a jóváhagyott közzétételi mechanizmusok (APA-k) és az összesítettadat-szolgáltatók (CTP-k) által e kérésekre küldendő válaszok részleteit határozza meg a kereskedés előtti és a kereskedés utáni átláthatóságra és a kereskedési kötelezettségre vonatkozó szabályok számítása és kiigazítása és különösen a következő tényezők meghatározása céljából:

a) hogy a tulajdonviszonyt megtestesítő eszközök és a részvényjellegű és a nem részvényjellegű pénzügyi eszközök likvid piaccal rendelkeznek-e;

b) a tulajdonviszonyt megtestesítő eszközökre és a részvényjellegű és a nem részvényjellegű pénzügyi eszközökre vonatkozó, kereskedés előtti átláthatósággal kapcsolatos mentességek küszöbértékei;

([1]) Az Európai Parlament és a Tanács 2004. április 21-i 2004/39/EK irányelve a pénzügyi eszközök piacairól, a 85/611/EGK és a 93/6/EGK tanácsi irányelv, és a 2000/12/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv módosításáról, valamint a 93/22/EGK tanácsi irányelv hatályon kívül helyezéséről (HL L 145., 2004.4.30., 1. o.).

([2]) A Bizottság 2006. augusztus 10-i 1287/2006/EK rendelete a 2004/39/EK európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a befektetési vállalkozások nyilvántartás-vezetési kötelezettségei, az ügyletek bejelentése, a piac átláthatósága, a pénzügyi eszközök piaci bevezetése, valamint az irányelv alkalmazásában meghatározott kifejezések tekintetében történő végrehajtásáról (HL L 241., 2006.9.2., 1. o.).

([3]) Az Európai Parlament és a Tanács 2010. november 24-i 1095/2010/EU rendelete az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapír-piaci Hatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/77/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről (HL L 331., 2010.12.15., 84. o.).

c) a tulajdonviszonyt megtestesítő eszközökre és a részvényjellegű és a nem részvényjellegű pénzügyi eszközökre vonatkozó, kereskedés utáni átláthatósággal kapcsolatos halasztások küszöbértékei;

d) hogy a pénzügyi eszközök adott osztályának likviditása mikor esik a meghatározott küszöbérték alá;

e) hogy a befektetési vállalkozás rendszeres internalizálónak minősül-e;

f) a tulajdonviszonyt megtestesítő eszközökkel és részvényjellegű eszközökkel kereskedő rendszeres internalizálókra alkalmazandó szokásos piaci nagyságrend, illetve a nem részvényjellegű eszközökkel kereskedő rendszeres internalizálókra alkalmazandó eszközspecifikus nagyságrend;

g) a tulajdonviszonyt megtestesítő eszközök és a részvényjellegű eszközök kapcsán a kereskedés összvolumene az előző 12 hónapban, továbbá az előre letárgyalt kereskedéssel és a referenciaárral kapcsolatos mentességek keretében végrehajtott kereskedésnek az Unió egész területe és az egyes kereskedési helyszínek vonatkozásában számított százalékos aránya az előző 12 hónapban;

h) hogy a származtatott termékek kellően likvidek-e a származtatott termékekre vonatkozó kereskedési kötelezettség végrehajtása céljából.

2. cikk

Az adatkérések és a szolgáltatandó információk tartalma

(1) Az előre meghatározott dátumokon vagy előre meghatározott gyakorisággal felmerülő számítások elvégzése céljából a kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k az összes olyan adatot illetékes hatóságaik rendelkezésére bocsátják, amely a következő rendeletekben előírt számítások elvégzéséhez szükséges:

a) az (EU) 2017/587 felhatalmazáson alapuló rendelet;

b) az (EU) 2017/583 felhatalmazáson alapuló rendelet;

c) az (EU) 2017/567 felhatalmazáson alapuló rendelet;

d) az (EU) 2017/565 felhatalmazáson alapuló rendelet.

(2) Az illetékes hatóságok az 1. cikk a)–f) és h) pontjában említett küszöbértékek és paraméterek nyomon követése és kiigazítása céljából szükség esetén további információkat kérhetnek a kereskedési helyszínektől, APA-któl és CTP-ktől.

(3) Az illetékes hatóságok az összes olyan adatot kérhetik, amelyet az ESMA-nak az (EU) 2016/2020 felhatalmazáson alapuló rendeletnek megfelelően figyelembe kell vennie, ideértve a következőkre vonatkozó adatokat:

a) a kötések átlagos gyakorisága;

b) a kötések átlagos nagyságrendje és eloszlása;

c) a piaci szereplők száma és típusa;

d) az eladási és vételi ár különbségének (spread) átlagos nagysága.

3. cikk

Az adatkérések gyakorisága és a kereskedési helyszínek, az APA-k és a CTP-k válaszadási ideje

(1) A kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k minden nap megküldik a 2. cikk (1) bekezdésében említett adatokat.

(2) A kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k a 2. cikk (2) bekezdése szerinti eseti kérésre válaszul szolgáltatott adatokat a kérés kézhezvételétől számított négy héten belül küldik meg, kivéve, ha a kérésben meghatározott kivételes körülmények rövidebb határidőt tesznek szükségessé.

(3) Az (1) és a (2) bekezdéstől eltérve a kereskedési helyszínek és a CTP-k a volumenkorlátozási mechanizmus céljára szolgáló adatokat a 6. cikk (6)–(9) bekezdésének megfelelően küldik meg.

4. cikk

Az adatkérések formátuma

A kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k a 2. cikkben említett adatokat általános XML formátumban küldik meg, adott esetben a szolgáltatott adatok hatékony és automatizált feldolgozása és más forrásokból származó hasonló adatokkal való konszolidációja érdekében meghatározott, tartalomra és formátumra vonatkozó egyéb specifikációnak is megfelelve.

5. cikk

A tárolandó adatok típusa és a kereskedési helyszínekre, APA-kra és CTP-kre érvényes adattárolási minimumidőtartam

(1) A kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k a 2. cikkben meghatározott küszöbértékek és paraméterek kiszámításához, nyomon követéséhez vagy kiigazításához szükséges adatokat attól függetlenül tárolják, hogy ezeket az információkat közzétették-e vagy sem.

(2) A kereskedési helyszínek, APA-k és CTP-k az (1) bekezdésben említett adatokat legalább három évig tárolják.

6. cikk

A kereskedési helyszínek és a CTP-k volumenkorlátozási mechanizmussal kapcsolatos adatszolgáltatási kötelezettségei

(1) A kereskedési helyszínek a 600/2014/EU rendelet 3. cikke szerinti átláthatósági követelmények hatályába tartozó minden egyes pénzügyi eszköz tekintetében benyújtják a következő adatokat az illetékes hatóságnak:

a) a pénzügyi eszköz vonatkozásában az adott kereskedési helyszínen végrehajtott kereskedés összvolumene;

b) a pénzügyi eszköz vonatkozásában az adott kereskedési helyszínen a 600/2014/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdésének a) pontja vagy 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának i. alpontja szerinti mentességek keretében végrehajtott kereskedés összvolumene, külön-külön adatot szolgáltatva az egyes mentességek összvolumenéről.

(2) A CTP-k a 600/2014/EU rendelet 3. cikke szerinti átláthatósági követelmények hatályába tartozó minden egyes pénzügyi eszköz tekintetében és az illetékes hatóság kérésére benyújtják a következő adatokat az illetékes hatóságnak:

a) a pénzügyi eszköz vonatkozásában az Unió összes kereskedési helyszínén végrehajtott kereskedés összvolumene, külön-külön adatot szolgáltatva az egyes kereskedési helyszínek összvolumenéről;

b) a pénzügyi eszköz vonatkozásában az Unió összes kereskedési helyszínén a 600/2014/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdésének a) pontja vagy 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának i. alpontja szerinti mentességek keretében végrehajtott kereskedés összvolumene, külön-külön adatot szolgáltatva az egyes mentességek és az egyes kereskedési helyszínek összvolumenéről.

(3) A kereskedési helyszínek és a CTP-k az (1) és a (2) bekezdésben meghatározott adatokat a mellékletben bemutatott formátumnak megfelelően szolgáltatják az illetékes hatóságok részére. Biztosítják különösen, hogy az általuk megadott kereskedésihelyszín-azonosítók kellően részletesek ahhoz, hogy az illetékes hatóságok és az ESMA az egyes kereskedési helyszínek tekintetében azonosítani tudják a referenciaárral kapcsolatos és – likvid pénzügyi eszközök vonatkozásában – az előre letárgyalt kereskedéssel kapcsolatos mentesség keretében végrehajtott kereskedés volumenét, és hogy lehetővé tegye a 600/2014/EU rendelet 5. cikke (1) bekezdésének a) pontjában említett arány kiszámítását.

(4) Az (1) és a (2) bekezdésben említett volumenek kiszámítása céljából:

a) az egyedi ügylet volumenét a pénzügyi eszköz árának és a kereskedett egységek számának szorzataként kell meghatározni;

b) az egyes pénzügyi eszközök vonatkozásában az (1) bekezdés a) pontjában és a (2) bekezdés a) pontjában meghatározott kereskedési összvolument az adott pénzügyi eszközre vonatkozó összes egyedi és egyszer számba vett ügylet volumenének aggregátumaként kell meghatározni;

c) az (1) bekezdés b) pontjában és a (2) bekezdés b) pontjában meghatározott kereskedési volumeneket az olyan adott pénzügyi eszközre vonatkozó összes egyedi és egyszer számba vett ügylet volumenének aggregátumaként kell meghatározni, amelyről az (EU) 2017/587 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. mellékletének 4. táblázata szerinti „referenciaár” vagy „likvid pénzügyi eszközök előre letárgyalt ügyletei” minősítéssel szolgáltatnak adatot.

(5) A kereskedési helyszínek és a CTP-k csak az azonos pénznemben végrehajtott ügyleteket aggregálják, és külön-külön szolgáltatnak adatot az ügylethez használt egyes pénznemekben aggregált volumenekről.

(6) A kereskedési helyszínek az (1)–(5) bekezdésben említett adatokat minden naptári hónap első és tizenhatodik napján, közép-európai idő szerint 13.00 óráig nyújtják be az illetékes hatóságnak. Ha a naptári hónap első vagy tizenhatodik napja a kereskedési helyszínen nem munkanap, akkor a kereskedési helyszín az adatokat a következő munkanapon, közép-európai idő szerint 13.00 óráig nyújtja be az illetékes hatóságnak.

(7) A kereskedési helyszínek az (1)–(5) bekezdésnek megfelelően meghatározott kereskedési összvolumeneket a következő időszakok tekintetében nyújtják be az illetékes hatóságoknak:

a) a naptári hónap tizenhatodik napján nyújtandó adatszolgáltatás esetében a végrehajtási időszak az ugyanazon naptári hónap első napja és tizenötödik napja közötti időszak;

b) a naptári hónap első napján nyújtandó adatszolgáltatás esetében a végrehajtási időszak az előző naptári hónap tizenhatodik napja és utolsó napja közötti időszak.

(8) A (6) és a (7) bekezdéstől eltérve a kereskedési helyszínek a pénzügyi eszközönkénti első adatszolgáltatásokat a 2014/65/EU irányelv és a 600/2014/EU rendelet hatálybalépése napján, közép-európai idő szerint 13.00 óráig nyújtják be, az (1) bekezdésben említett kereskedési volumeneket az előző naptári év tekintetében megadva. A kereskedési helyszínek e célból minden naptári hónap tekintetében külön-külön adatszolgáltatást nyújtanak be a következőkről:

a) a naptári hónap első napja és tizenötödik napja közötti időszak kereskedési volumene;

b) a naptári hónap tizenhatodik napja és utolsó napja közötti időszak kereskedési volumene.

(9) A kereskedési helyszínek és a CTP-k az illetékes hatóságok azon kereskedési volumenekre irányuló eseti kéréseit, amelyek a referenciaárral vagy az előre letárgyalt kereskedéssel kapcsolatos mentességek alkalmazásának nyomon követése érdekében elvégzendő számításhoz szükségesek, a kérést követő első munkanap végéig válaszolják meg.

7. cikk

Az illetékes hatóságoknak a volumenkorlátozási mechanizmussal és a származtatott termékekre vonatkozó kereskedési kötelezettséggel kapcsolatos, ESMA-val szembeni adatszolgáltatási kötelezettségei

(1) Az illetékes hatóságok a kereskedési helyszíntől vagy CTP-től a 6. cikknek megfelelően kapott adatokat a kézhezvételt követő első munkanapon, közép-európai idő szerint 13.00 óráig az ESMA rendelkezésére bocsátják.

(2) Az illetékes hatóságok a kereskedési helyszíntől, APA-tól vagy CTP-től annak meghatározása céljából kapott adatokat, hogy a származtatott termékek az 1. cikk h) pontjának megfelelően kellően likvidek-e, indokolatlan késedelem nélkül, de legkésőbb a vonatkozó adatok kézhezvételét követő három munkanapon belül az ESMA rendelkezésére bocsátják.

8. cikk

Az ESMA volumenkorlátozási mechanizmussal kapcsolatos adatszolgáltatási kötelezettségei

(1) Az ESMA a 600/2014/EU rendelet 5. cikke (4), (5) és (6) bekezdésnek megfelelően az egyes pénzügyi eszközök vonatkozásában legkésőbb az e rendelet 6. cikkének (6) bekezdésében meghatározott adatszolgáltatási időszak végét követő ötödik munkanapon, közép-európai idő szerint 22.00 óráig közzéteszi az előző 12 havi kereskedés összvolumenét és az előző 12 hónapban az előre letárgyalt kereskedéssel és a referenciaárral kapcsolatos mentességek alkalmazása mellett folyó kereskedésnek az Unió egész területe és az egyes kereskedési helyszínek vonatkozásában számított százalékos arányát.

(2) Az (1) bekezdésben említett közzétételre ingyenesen, az (EU) 2017/571 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ([1]) 14. cikkében és az (EU) 2017/567 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 13. cikkének (4) és (5) bekezdésében meghatározott gép által olvasható és ember által olvasható formátumban kerül sor.

([1]) A Bizottság (EU) 2017/571 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. június 2.) a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek az adatszolgáltatók engedélyezésére, szervezeti követelményeire és az ügyletek általuk történő közzétételére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 126. oldalát).

(3) Ha a pénzügyi eszközzel az Unió területén egynél több pénznemben kereskednek, az ESMA az Európai Központi Bank által az előző 12 hónapban a honlapján közzétett napi euro-devizaárfolyamok alapján számított átlagárfolyamok használatával az összes volument átszámítja euróra. Ezeket az átszámított volumeneket kell használni az (1) bekezdésben említett kereskedési összvolumen, illetve az előre letárgyalt kereskedéssel és a referenciaárral kapcsolatos mentességek alkalmazása mellett folyó kereskedésnek az Unió egész területe és az egyes kereskedési helyszínek vonatkozásában számított százalékos aránya számításához és közzétételéhez.

9. cikk

Hatálybalépés és alkalmazás

Ez a rendelet az Európai Unió Hivatalos Lapjában való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet 2018. január 3-tól alkalmazandó.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2016. június 13-án.

a Bizottság részéről
az elnök
Jean-Claude JUNCKER

MELLÉKLET

1. táblázat

A 2. táblázatban használt jelölések magyarázata

JELÖLÉS	ADATTÍPUS	MEGHATÁROZÁS
{ALPHANUM-n}	Legfeljebb n számú alfanumerikus karakter	Szövegmező
{DECIMAL-n/m}	Összesen legfeljebb n számjegyből álló tizedes tört, mely legfeljebb m számú tizedesjegyet tartalmazhat	Numerikus mező pozitív és negatív értékek megjelöléséhez. — Tizedesjel:„,” (vessző); — a negatív számok „–” (mínusz) előjellel jelölhetők. Az értékeket – ahol szükséges – kerekíteni kell, azaz nem csonkolhatók.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerikus karakter	Az ISO 4217 pénznemkódoknak megfelelő hárombetűs pénznemkód.
{DATEFORMAT}	ISO 8601 szerinti dátumformátum	A dátumokat a következő formátumban kell megadni: ÉÉÉÉ-HH-NN
{ISIN}	12 alfanumerikus karakter	Az ISO 6166 szabványnak megfelelő ISIN-kód.
{MIC}	4 alfanumerikus karakter	Az ISO 10383 szabványnak megfelelő piacazonosító.

2. táblázat

A volumenkorlátozási mechanizmus céljából történő adatszolgáltatás formátuma

Adatmező neve	Formátum
Adatszolgáltatási időszak	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} ahol az első dátum az adatszolgáltatási időszak kezdete, a második dátum pedig az adatszolgáltatási időszak vége.
Adatszolgáltató szervezet azonosítása	Ha az adatszolgáltató szervezet kereskedési helyszín: {MIC} (szegmensazonosító MIC vagy adott esetben működtetőazonosító MIC) vagy {ALPHANUM-50} ha az adatszolgáltató szervezet CTP:
Kereskedésihelyszín-azonosító	{MIC} (szegmens MIC, ha rendelkezésre áll, egyébként operatív MIC)
Eszközazonosító	{ISIN}
Az ügyletek pénzneme	{CURRENCYCODE_3}
A kereskedés összvolumene (pénznemenként)	{DECIMAL-18/5}

Adatmező neve	Formátum
A MiFIR 4. cikke (1) bekezdésének a) pontja szerinti, referenciaárral kapcsolatos mentesség keretében folytatott kereskedés összvolumene (pénznemenként)	{DECIMAL-18/5}
A MiFIR 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának i. alpontja szerinti, előre letárgyalt ügyletekkel kapcsolatos mentesség keretében folytatott kereskedés összvolumene (pénznemenként)	{DECIMAL-18/5}