DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2021/527 DER KOMMISSION

vom 15. Dezember 2020

zur Änderung der Delegierten Verordnung (EU) 2017/565 im Hinblick auf die Schwellenwerte für wöchentliche Positionsmeldungen

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU ([1]), insbesondere auf Artikel 58 Absatz 6,

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) In Artikel 83 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/565 der Kommission ([2]) werden die in Artikel 58 Absatz 1 Unterabsatz 2 der Richtlinie 2014/65/EU vorgesehenen Mindestschwellen festgelegt, bei deren Überschreitung Handelsplätze wöchentliche Berichte im Sinne von Artikel 58 Absatz 1 Buchstabe a der genannten Richtlinie veröffentlichen müssen.

(2) Die Mindestschwelle für das Volumen der offenen Positionen sollte geändert werden, um den Beteiligten bei einem breiteren Spektrum von Warenderivaten Transparenz zu verschaffen. Die Veröffentlichung wöchentlicher Positionsmeldungen sollte nicht mehr vom Verhältnis zwischen den offenen Kontraktpositionen in einem Warenderivat und der lieferbaren Menge desselben Warenderivats abhängen, sondern vielmehr auf einem einfacheren Kriterium beruhen, nämlich dem Volumen der offenen Kontraktpositionen in diesem Warenderivat.

(3) Was den Schwellenwert für die offenen Kontraktpositionen betrifft, so sollten dann wöchentliche Positionsmeldungen veröffentlicht werden, wenn die Gesamtheit der offenen Kontraktpositionen im Spot-Monat und in anderen Monaten mindestens 10 000 Handelseinheiten beträgt, damit sichergestellt wird, dass ein ausreichendes Interesse an einem Warenderivat besteht, um die Veröffentlichung wöchentlicher Positionsmeldungen zu rechtfertigen.

(4) Um das Risiko von Vertraulichkeitsverletzungen in Bezug auf Positionsinhaber zu verringern, enthält die wöchentlich zu veröffentlichende Positionsmeldung im Falle von Kontrakten mit weniger als fünf Positionsinhabern, die in einer bestimmten Personenkategorie aktiv sind, keine Informationen zu dieser Personenkategorie.

(5) Die Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 sollte daher entsprechend geändert werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Artikel 83 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/565 wird wie folgt geändert:

1. Absatz 1 wird wie folgt geändert:

   a) Unterabsatz 1 Buchstabe b erhält folgende Fassung:

      „b) der absolute Betrag des Bruttovolumens der Long- und Shortpositionen aller offenen Kontraktpositionen, ausgedrückt in der Anzahl der Handelseinheiten des betreffenden Warenderivats, beträgt mindestens 10 000."

   b) Unterabsatz 2 erhält folgende Fassung:

      „Bei Emissionszertifikaten und Derivaten derselben gilt Buchstabe b nicht."

([1]) ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349.

([2]) Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 der Kommission vom 25. April 2016 zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die organisatorischen Anforderungen an Wertpapierfirmen und die Bedingungen für die Ausübung ihrer Tätigkeit sowie in Bezug auf die Definition bestimmter Begriffe für die Zwecke der genannten Richtlinie (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 1).

2. Absatz 3 erhält folgende Fassung:

„(3) Bei Kontrakten mit weniger als fünf aktiven Positionsinhabern einer bestimmten Personenkategorie werden die aggregierten Kauf- und Verkaufspositionen, diesbezügliche Änderungen seit dem letzten Bericht, der Prozentsatz der gesamten offenen Kontraktpositionen in dieser Kategorie und die Anzahl der Positionsinhaber in dieser Kategorie nicht veröffentlicht."

Artikel 2

Diese Verordnung tritt am dritten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 15. Dezember 2020

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN