

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/577**2016 m. birželio 13 d.****kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas apimties viršutinės ribos mechanizmo ir informacijos teikimo skaidrumo ir kitų skaičiavimų tikslams techniniais reguliavimo standartais****(Tekstas svarbus EEE)**

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾, ypač į jo 5 straipsnio 9 dalį ir 22 straipsnio 4 dalį,

kadangi:

- (1) Reglamentu (ES) Nr. 600/2014 kompetentingos institucijos ir Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija (EVPRI) įpareigojamos atlikti labai daug skaičiavimų, kad pritaikytų skaidrumo prieš sudarant ir sudarius sandorį tvarką ir išvestinėms finansinėms priemonėms taikomą prekybos pareigą, taip pat kad nustatytų, ar investicinė įmonė yra sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas;
- (2) kompetentingos institucijos ir EVPRI reikiamus skaičiavimus gali atlikti tik turėdamos kiekvienos turto klasės, kuriai taikomas Reglamentas (ES) Nr. 600/2014, patikimų aukštos kokybės duomenų. Todėl būtina didinti duomenų, pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2014/65/ES ⁽²⁾ ir Reglamentą (ES) Nr. 600/2014 teikiamų kompetentingoms institucijoms ir EVPRI, prieinamumą ir kokybę, kad praėjus tam tikram tvarkos taikymo laikotarpiui finansinių priemonių klasifikavimo skaičiavimus, įskaitant ribų, taikomų skaidrumo prieš sudarant ir sudarius sandorį tikslais, skaičiavimus ir prireikus šių ribų pakartotinio pritaikymo skaičiavimus, būtų galima atlikti turint daugiau informacijos;
- (3) reikėtų nustatyti nuostatas, kuriomis bendrais bruožais būtų nustatyti prekybos vietų, patvirtintų skelbimo subjektų (PSS) ir konsoliduotos informacinės juostos teikėjų (KIJT) skaidrumo ir kitų skaičiavimų tikslais teiktinų duomenų turinio ir formos bendrieji elementai. Tas nuostatas reikėtų taikyti kartu su Komisijos deleguotaisiais reglamentais (ES) 2017/587 ⁽³⁾, (ES) 2017/583 ⁽⁴⁾, (ES) 2017/567 ⁽⁵⁾, (ES) 2017/565 ⁽⁶⁾ ir (ES) 2016/2020 ⁽⁷⁾,

⁽¹⁾ OL L 173, 2014 6 12, p. 84.

⁽²⁾ 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamas Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES (OL L 173, 2014 6 12, p. 349).

⁽³⁾ 2016 m. liepos 14 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/587, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais dėl akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių ir su pareiga tam tikrų akcijų sandorius vykdyti prekybos vietoje arba per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 387).

⁽⁴⁾ 2016 m. liepos 14 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/583, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais, susijusiais su obligacijomis, struktūrizuotais finansiniais produktais, apyvartiniais taršos leidimais ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 229).

⁽⁵⁾ 2016 m. gegužės 18 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/567, kuriuo papildomas Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 600/2014 nuostatos dėl apibrėžčių, skaidrumo, portfelio suspaudimo ir su produktais susijusių intervencinių priemonių ir pozicijų priežiūros priemonių (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 90).

⁽⁶⁾ 2016 m. balandžio 25 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/565, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma nuostatomis dėl investicinių įmonių organizacinių reikalavimų bei veiklos sąlygų ir toje direktyvoje apibrėžtų terminų (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 1).

⁽⁷⁾ 2016 m. gegužės 26 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2016/2020, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas nustatymo, ar išvestinėms finansinėms priemonėms, kurioms taikoma tarpusukaitos pareiga, turėtų būti taikoma prekybos pareiga, kriterijų techniniais reguliavimo standartais (OL L 313, 2016 11 19, p. 2).

kuriuose aprašoma atitinkamų skaičiavimų metodika ir jiems reikalingi duomenys ir patikslinamas skaidrumo skaičiavimams reikalingų duomenų turinys ir apimtis. Todėl teikiamų prekybos vietų, PSS ir KIJT duomenų turinys, forma ir kokybė turėtų atitikti tokiems skaičiavimams taikytiną metodiką pagal atitinkamus Direktyvos 2014/65/ES įgyvendinimo aktus ir Reglamentą (ES) Nr. 600/2014;

- (4) prekybos vietos, PSS ir KIJT turėtų teikti duomenis kas dieną, išskyrus atvejus, kai gauna *ad hoc* prašymus pateikti duomenis ir turi atlikti apskaičiavimus dėl apimties viršutinės ribos mechanizmo. Atsižvelgiant į didelę finansinių priemonių, patenkančių į taikymo sritį, įvairovę ir didelį tvarkytinų duomenų kiekį, toks kasdienis duomenų teikimas leistų kompetentingoms institucijoms tiksliau tvarkyti valdomo dydžio rinkmenas ir užtikrintų veiksmingą ir laiku atliekamą duomenų teikimo valdymą, duomenų kokybės patikrinimą ir duomenų tvarkymą. Be to, dėl kasdienio duomenų rinkimo prekybos vietoms, PSS ir KIJT būtų paprasčiau laikytis duomenų teikimo pareigos, nes nebeliktų naštos apskaičiuoti prekybos dienų skaičių tais atvejais, kai taikytinas kiekybinis likvidumo kriterijus, ir agreguoti tos pačios finansinės priemonės duomenis skirtingais išpirkimo terminų intervalais, kai reikia atsižvelgti į laiką iki išpirkimo termino. Centralizuotai atliekant tuos skaičiavimus taip pat užtikrinamas nuoseklus kriterijų taikymas visoms finansinėms priemonėms ir prekybos vietoms;
- (5) prekybos vietos turėtų saugoti išsamius duomenis, kuriuos turėdamos kompetentingos institucijos ir EVPRI galėtų atlikti tikslus skaičiavimus. Reikiama informacija paprastai pateikiama pranešimuose sudarius sandorį, tačiau kai kada skaičiavimams reikia daugiau informacijos, nei įtraukiama į tuos pranešimus. Pavyzdžiui, tai informacija apie sandorius, įvykdytus pagal pavedimus, kuriems taikytas plataus masto leidimas nesilaikyti reikalavimų. Ši informacija neturėtų būti įtraukiama į prekybos pranešimus, nes dėl jos tokiems sandoriams galėtų grėsti neigiamas rinkos poveikis. Tačiau dėl to, kad šios informacijos gali reikėti kompetentingoms institucijoms tiksliesiems skaičiavimams atlikti, prekybos vietos, PSS ir KIJT turėtų ją deramai saugoti ir prireikus pateikti kompetentingoms institucijoms ir EVPRI. Prekybos vietos turėtų užtikrinti tinkamą informacijos, pateiktinos kompetentingoms institucijoms ir EVPRI, sklaidą. KIJT skirtingame pranešime jos turėtų tinkamai identifikuoti sandorius, įvykdytus pagal didelės apimties pavedimus;
- (6) duomenys turėtų būti renkami iš įvairių šaltinių, nes iš vieno šaltinio ne visada galima gauti visus turto klasės ar net konkrečios finansinės priemonės duomenis. Todėl, siekdamas suteikti kompetentingoms institucijoms ir EVPRI galimybę gauti ir konsoliduoti aukštos kokybės duomenis iš įvairių šaltinių, prekybos vietos, PSS ir KIJT esant galimybei turėtų laikytis iš anksto nustatytų turinio ir formos specifikacijų, kad duomenų rinkimas būtų paprastesnis ir ekonomiškai efektyvesnis;
- (7) atsižvelgiant į reikiamų skaičiavimų jautrumą ir klaidingos informacijos paskelbimo galimas komercines pasekmes prekybos vietoms, emitentams ir kitiems rinkos dalyviams, kurios apimties viršutinės ribos mechanizmo atveju galėtų lemti leidimo nesilaikyti reikalavimų sustabdymą vienai konkrečiai prekybos vietai arba visos Sąjungos mastu vienos konkrečios finansinės priemonės atžvilgiu, būtina patikslinti kompetentingoms institucijoms ir EVPRI teiktinų duomenų formą, kad būtų nustatyti veiksmingi ryšių kanalai su prekybos vietomis ir KIJT bei užtikrintas teisingų reikiamų duomenų paskelbimas laiku;
- (8) Reglamentu (ES) Nr. 600/2014 EVPRI įpareigojama skelbti tų finansinių priemonių, kurioms taikomas apimties viršutinės ribos mechanizmas, ankstesnių 12 mėnesių bendros prekybos apimties apskaičiavimą ir ankstesnių 12 mėnesių prekybos pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų ir referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų visoje Sąjungoje ir kiekvienoje prekybos vietoje procentinių dalių apskaičiavimą. Kai finansinėmis priemonėmis prekiaujama daugiau nei viena valiuta, privaloma konvertuoti prekybos apimtį, išreikštą skirtingomis valiutomis, į vieną bendrą valiutą, kad būtų galima apskaičiuoti tą apimtį ir atlikti reikiamus skaičiavimus. Todėl reikėtų numatyti metodiką ir valiutos kursus, taikytinus, kai reikia konvertuoti prekybos apimtį;
- (9) dėl apimties viršutinės ribos mechanizmo prekybos vietos turėtų būti įpareigosios pranešti prekybos, vykdytos pagal referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų, o likvidžių finansinių priemonių atvejų – pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų, apimtį. Atsižvelgiant į tai, kad leidimai netaikyti reikalavimų taikomi ne sandoriams, o pavedimams, svarbu paaiškinti, kad sandorių skelbimo sudarius sandorį tikslu ir kaip nurodyta Deleguotajame reglamente (ES) 2017/587 į praneštiną apimtį reikėtų įskaičiuoti visus sandorius su žymomis RFPT arba NLIQ. Kai sandoris įvykdytas pagal du pavedimus, kuriems taikytas plataus masto leidimas nesilaikyti reikalavimų, į šį sandorį neturėtų būti atsižvelgiama apskaičiuojant apimtį pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų ir referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų;
- (10) dėl apimties viršutinės ribos mechanizmo prekybos vietos ir KIJT turėtų užtikrinti, kad prekybos vieta, kurioje buvo įvykdytas sandoris, būtų nurodoma pakankamai detalai, kad EVPRI galėtų atlikti visus Reglamente (ES)

Nr. 600/2014 nurodytus skaičiavimus. Visų pirma, naudojamas prekybos vietos identifikatorius turėtų žymėti tik tą prekybos vietą ir nebūti naudojamas kitoms to paties rinkos dalyvio valdomoms prekybos vietoms žymėti. Pagal prekybos vietų identifikatorius EVPRI turėtų galėti vienareikšmiškai atskirti visas prekybos vietas, kurių atžvilgiu rinkos dalyvis yra gavęs specialų leidimą pagal Direktyvą 2014/65/ES;

- (11) taikant apimtį viršutinės ribos mechanizmą, būtina įpareigoti prekybos vietas pirmą pranešimą, jame nurodant praėjusių kalendorinių metų prekybos, vykdytos pagal referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų, o likvidžių finansinių priemonių atveju – pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų, apimtį, pateikti Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2014/65/ES ir Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dieną. Siekiant užtikrinti proporcingą šio reikalavimo taikymą, tuo tikslu prekybos vietos turėtų savo pranešimus pagrįsti patikslinta prekybos, vykdytos pagal lygiaverčius leidimus nesilaikyti reikalavimų, nustatytas Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2004/39/EB ⁽¹⁾ ir Komisijos reglamentu (EB) Nr. 1287/2006 ⁽²⁾, apimtimi;
- (12) siekdamas kompetentingoms institucijoms ir EVPRI pateikti tikslius duomenis, prekybos vietos, PSS ir KIJT turėtų užtikrinti, kad į savo pranešimus konkrečius sandorius įtrauktų tik vieną kartą;
- (13) šio reglamento nuostatos yra glaudžiai susijusios tarpusavyje, nes jomis patikslinamas prašymų pateikti duomenis turinys, periodiškumas ir forma, šių duomenų tvarkymo metodas ir informacijos skelbimo skaidrumo tikslu, kaip apibrėžta pagal Reglamentą (ES) Nr. 600/2014, kitos specifikacijos. Siekiant užtikrinti šių nuostatų, kurios įsigalios vienu metu, tarpusavio nuoseklumą ir palengvinti sąlygas visapusiškai jas apžvelgti suinteresuotiesiems subjektams, ypač tiems, kuriems taikomos šios pareigos, pageidautina šias nuostatas pateikti viename reglamente;
- (14) nuoseklumo sumetimais ir siekiant užtikrinti sklandų finansų rinkų veikimą, būtina, kad šiame reglamente ir Reglamente (ES) Nr. 600/2014 nustatytos nuostatos būtų pradėtos taikyti nuo tos pačios dienos;
- (15) šis reglamentas grindžiamas EVPRI Komisijai pateiktais techninių reguliavimo standartų projektais;
- (16) EVPRI dėl techninių reguliavimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnaginėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ⁽³⁾ 37 straipsniu, pateikti savo nuomonę.

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Dalykas ir taikymo sritis

1. Šiuo reglamentu nustatomi kompetentingų institucijų siųstinių prašymų pateikti duomenis elementai ir prekybos vietų, patvirtintų skelbimo subjektų (PSS) ir konsoliduotos informacinės juostos teikėjų (KIJT) siųstinių atsakymų į tuos prašymus elementai, kai šie prašymai ir atsakymai į juos teikiami skaidrumo prieš sudarant ir sudarius sandorį ir prekybos pareigos tvarkos apskaičiavimo ir patikslinimo tikslais, visų pirma siekiant nustatyti šiuos veiksmus:

- a) ar nuosavo kapitalo finansinių priemonių, į jas panašių priemonių ir ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių rinka yra likvidi;
- b) skaidrumo reikalavimų prieš sudarant nuosavo kapitalo finansinių priemonių, į jas panašių priemonių ir ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių sandorius netaikymo ribas;

⁽¹⁾ 2004 m. balandžio 21 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2004/39/EB dėl finansinių priemonių rinkų, iš dalies keičianti Tarybos direktyvas 85/611/EEB, 93/6/EEB ir Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2000/12/EB bei panaikinanti Tarybos direktyvą 93/22/EEB (OL L 145, 2004 4 30, p. 1).

⁽²⁾ 2006 m. rugpjūčio 10 d. Komisijos reglamentas (EB) Nr. 1287/2006, įgyvendinantis Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2004/39/EB dėl investicinėms įmonėms taikomų apskaitos dokumentų tvarkymo reikalavimų, informacijos apie sandorius pateikimo, rinkos skaidrumo, leidimų prekiauti finansinėmis priemonėmis ir toje direktyvoje apibrėžtų sąlygų (OL L 241, 2006 9 2, p. 1).

⁽³⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

- c) skaidrumo reikalavimų sudarius nuosavo kapitalo finansinių priemonių, į jas panašių priemonių ir ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių sandorius taikymo atidėjimo ribas;
- d) kada tam tikros klasės finansinių priemonių likvidumas sumažėja labiau už nurodytą ribą;
- e) ar investicinė įmonė yra sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas;
- f) standartinį rinkos dydį, taikytiną sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, prekiaujantiems nuosavo kapitalo finansinėmis priemonėmis ir į jas panašiomis priemonėmis, ir priemonės dydį, taikomą sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, prekiaujantiems ne nuosavo kapitalo finansinėmis priemonėmis;
- g) nuosavo kapitalo finansinių priemonių ir į jas panašių priemonių atveju – ankstesnių 12 mėnesių prekybos bendrą apimtį ir ankstesnių 12 mėnesių prekybos pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų ir referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų visoje Sąjungoje ir kiekvienoje prekybos vietoje procentines dalis;
- h) ar išvestinės finansinės priemonės yra pakankamai likvidžios, kad joms reikėtų taikyti prekybos pareigą.

2 straipsnis

Prašymų pateikti duomenis ir pateiktinos informacijos turinys

1. Kad būtų galima atlikti skaičiavimus tam tikromis iš anksto nustatytomis dienomis arba iš anksto nustatyto periodiškumu, prekybos vietos, PSS ir KIJT savo kompetentingoms institucijoms pateikia visus skaičiavimams atlikti būtinus duomenis, nurodytus šiuose reglamentuose:
 - a) Deleguotajame reglamente (ES) 2017/587;
 - b) Deleguotajame reglamente (ES) 2017/583;
 - c) Deleguotajame reglamente (ES) 2017/567;
 - d) Deleguotajame reglamente (ES) 2017/565.
2. Kompetentingos institucijos prireikus gali paprašyti prekybos vietų, PSS ir KIJT pateikti papildomos informacijos, kad galėtų stebėti ir patikslinti 1 straipsnio a–f ir h punktuose nurodytas ribas ir parametrus.
3. Kompetentingos institucijos gali paprašyti visos informacijos apie ne nuosavybės finansines priemones, į kurią EVPRI privalo atsižvelgti pagal Deleguotąjį reglamentą (ES) 2016/2020, įskaitant tokius duomenis:
 - a) vidutinį sandorių dažnį;
 - b) vidutinį sandorių dydį ir pasiskirstymą;
 - c) rinkos dalyvių skaičių ir tipą;
 - d) vidutinį kainų skirtumo dydį.

3 straipsnis

Prašymų pateikti duomenis periodiškumas ir prekybos vietų, PSS ir KIJT atsakymo terminai

1. Prekybos vietos, PSS ir KIJT 2 straipsnio 1 dalyje nurodytus duomenis pateikia kas dieną.
2. Gavusios *ad hoc* prašymą, kaip nurodyta 2 straipsnio 2 dalyje, prekybos vietos, PSS ir KIJT duomenis pateikia per keturias savaites nuo to prašymo gavimo, nebent dėl išskirtinių aplinkybių atsakyti reikia per trumpesnę laikotarpį, nurodytą prašyme.
3. Nukrypstant nuo 1 ir 2 dalių, prekybos vietos ir KIJT pateikia duomenis, naudotinus apimties viršutinės ribos mechanizmo tikslu, kaip nurodyta 6 straipsnio 6–9 dalyse.

4 straipsnis

Prašymų pateikti duomenis forma

Prekybos vietos, PSS ir KIJT pateikia 2 straipsnyje nurodytus duomenis bendruoju XML šablonu ir pagal kitas taikytinas turinio ir formos specifikacijas, nustatytas siekiant supaprastinti veiksmingą ir automatizuotą duomenų teikimo ir jų konsolidavimo su panašiais duomenimis iš kitų šaltinių procesą.

5 straipsnis

Privaloma tvarka saugotinų duomenų rūšis ir trumpiausias laikotarpis, kurį prekybos vietos, PSS ir KIJT turi saugoti duomenis

1. Prekybos vietos, PSS ir KIJT saugo visus duomenis, reikalingus 2 straipsnyje nurodytoms riboms ir parametrams apskaičiuoti, stebėti ar patikslinti, nepriklausomai nuo to, ar ši informacija yra paskelbta viešai ar ne.
2. Prekybos vietos, PSS ir KIJT 1 dalyje nurodytus duomenis saugo bent trejus metus.

6 straipsnis

Prekybos vietų ir KIJT duomenų teikimo reikalavimai taikant apimties viršutinės ribos mechanizmą

1. Prekybos vietos kompetentingai institucijai apie kiekvieną finansinę priemonę, kuriai pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 3 straipsnį taikomi skaidrumo reikalavimai, pateikia tokius duomenis:
 - a) bendrą prekybos ta finansine priemone toje prekybos vietoje apimtį;
 - b) bendrą prekybos ta finansine priemone toje prekybos vietoje apimtį atitinkamai pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a punkte arba 4 straipsnio 1 dalies b punkto i papunktyje nurodytus leidimus nesilaikyti reikalavimų, atskirai nurodydamos bendrą apimtį pagal kiekvieną leidimą nesilaikyti reikalavimų.
2. Gavę kompetentingos institucijos prašymą, KIJT kompetentingai institucijai apie kiekvieną finansinę priemonę, kuriai pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 3 straipsnį taikomi skaidrumo reikalavimai, pateikia tokius duomenis:
 - a) bendrą prekybos ta finansine priemone visose Sąjungos prekybos vietose apimtį, atskirai nurodydami bendrą prekybos kiekvienoje prekybos vietoje apimtį;
 - b) bendrą prekybos visose Sąjungos prekybos vietose apimtį atitinkamai pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a punkte arba 4 straipsnio 1 dalies b punkto i papunktyje nurodytus leidimus nesilaikyti reikalavimų, atskirai nurodydami bendrą apimtį pagal kiekvieną leidimą nesilaikyti reikalavimų ir pagal kiekvieną prekybos vietą.
3. Prekybos vietos ir KIJT kompetentingoms institucijoms 1 ir 2 dalyse nustatytus duomenis pateikia laikydamiesi priede pateiktų formų. Visų pirma jie užtikrina, kad jų pateikiami prekybos vietų identifikatoriai būtų pakankamai detalūs, kad kompetentinga institucija ir EVPRI galėtų nustatyti kiekvienoje prekybos vietoje vykusios prekybos, vykdytos pagal referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų, o likvidžių finansinių priemonių atvejų – pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų, apimtį ir apskaičiuoti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 5 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytą santykį.
4. Apskaičiuojant 1 ir 2 dalyse nurodytą apimtį:
 - a) atskiros sandorio apimtis nustatoma padauginant finansinės priemonės kainą iš parduotų vienetų skaičiaus;
 - b) bendra prekybos kiekviena finansine priemone apimtis, nurodyta 1 dalies a punkte ir 2 dalies a punkte, nustatoma agreguojant visų atskirų ir tik vieną kartą įskaičiuotų tos finansinės priemonės sandorių apimtį;
 - c) prekybos apimtis, nurodyta 1 dalies b punkte ir 2 dalies b punkte, nustatoma agreguojant atskirų ir tik vieną kartą įskaičiuotų tos finansinės priemonės sandorių apimtį, apie kurią pranešta su žymomis „referencinė kaina“ ir „suderėti sandoriai, susiję su likvidžiomis finansinėmis priemonėmis“ pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/587 I priedo 4 lentelę.

5. Prekybos vietos ir KIJT agreguoja tik sandorius, įvykdytus ta pačia valiuta, ir atskirai pateikia kiekvieną agreguotą apimtį sandorių valiuta.
6. Prekybos vietos pateikia 1–5 dalyse nurodytus duomenis kompetentingai institucijai pirmą ir šešioliktą kiekvieno kalendorinio mėnesio dieną iki 13.00 Vidurio Europos laiku. Kai pirmą arba šešioliktą kalendorinio mėnesio dieną prekybos vieta nedirba, ji duomenis kompetentingai institucijai pateikia iki kitos darbo dienos 13.00 Vidurio Europos laiku.
7. Prekybos vietos pateikia kompetentingai institucijai pagal 1–5 dalis apskaičiuotą bendrą prekybos apimtį per šiuos laikotarpius:
- a) šešioliktą kiekvieno kalendorinio mėnesio dieną teiktinuose pranešimuose vykdymo laikotarpis yra nuo pirmos iki penkioliktos to paties kalendorinio mėnesio dienos;
 - b) pirmą kiekvieno kalendorinio mėnesio dieną teiktinuose pranešimuose vykdymo laikotarpis yra nuo šešioliktos iki paskutinės ankstesnio kalendorinio mėnesio dienos.
8. Nukrypstant nuo 6 ir 7 dalių, prekybos vietos kiekvienos finansinės priemonės pirmą pranešimą, jame nurodydamos 1 dalyje nurodytą praėjusių kalendorinių metų prekybos apimtį, pateikia Direktyvos 2014/65/ES ir Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dieną iki 13.00 Vidurio Europos laiku. Todėl prekybos vietos atskirai pateikia šiuos kiekvieno kalendorinio mėnesio duomenis:
- a) prekybos apimtį laikotarpiu nuo pirmos iki penkioliktos kiekvieno kalendorinio mėnesio dienos;
 - b) prekybos apimtį laikotarpiu nuo šešioliktos iki paskutinės kiekvieno kalendorinio mėnesio dienos.
9. Prekybos vietos ir KIJT pateikia atsakymą į kiekvieną kompetentingų institucijų *ad hoc* prašymą dėl prekybos apimtys, kuris yra susijęs su atliktiniais skaičiavimais dėl suderėto sandorio arba referencinės kainos leidimo netaikyti reikalavimų taikymo stebėjimo, iki kitos darbo dienos po dienos, kurią gautas prašymas, pabaigos.

7 straipsnis

Kompetentingų institucijų duomenų teikimo EVPRI reikalavimai taikant apimtys viršutinės ribos mechanizmą ir išvestinėms finansinėms priemonėms taikomą prekybos pareigą

1. Kompetentingos institucijos duomenis, pagal 6 straipsnį gautus iš prekybos vietos arba KIJT, EVPRI pateikia iki kitos darbo dienos po tų duomenų gavimo 13.00 Vidurio Europos laiku.
2. Kompetentingos institucijos duomenis, gautus iš prekybos vietos, PSS arba KIJT siekiant nustatyti, ar išvestinės finansinės priemonės yra pakankamai likvidžios, kaip nurodyta 1 straipsnio h punkte, EVPRI pateikia be reikalo nedelsdamos ir ne vėliau kaip per tris darbo dienas nuo atitinkamų duomenų gavimo.

8 straipsnis

EVPRI duomenų teikimo reikalavimai, taikytini dėl apimtys viršutinės ribos mechanizmo

1. EVPRI skelbia ankstesnių 12 mėnesių prekybos kiekviena finansine priemone bendros apimtys apskaičiavimą ir ankstesnių 12 mėnesių prekybos pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų ir referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų visoje Sąjungoje ir kiekvienoje prekybos vietoje procentinių dalių apskaičiavimą pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 5 straipsnio 4, 5 ir 6 dalis ne vėliau kaip penktos darbo dienos nuo ataskaitinių laikotarpių, nurodytų šio reglamento 6 straipsnio 6 dalyje, pabaigos 22.00 Vidurio Europos laiku.
2. 1 dalyje nurodyti duomenys skelbiami nemokamai, kompiuteriu skaitoma ir žmogaus skaitoma forma, kaip apibrėžta Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/571 ⁽¹⁾ 14 straipsnyje ir Deleguotojo reglamento (ES) 2017/567 13 straipsnio 4 ir 5 dalyse.

⁽¹⁾ 2016 m. birželio 2 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/571, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma techniniais reguliavimo standartais dėl duomenų teikimo paslaugų teikėjams taikytinų veiklos leidimo išdavimo, organizacinių ir skelbimo apie sandorius reikalavimų (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 126).

3. Kai Sąjungoje finansine priemone prekiaujama daugiau nei viena valiuta, EVPRI konvertuoja kiekvieną apimtį į eurus pagal vidutinius valiutos kursus, apskaičiuotus pagal dienos orientacinius euro keitimo kursus, kuriuos savo interneto svetainėje per 12 ankstesnių mėnesių paskelbė Europos Centrinis Bankas. Konvertuota apimtis naudojama apskaičiuojant ir skelbiant bendrą prekybos apimtį ir prekybos pagal suderėto sandorio leidimą netaikyti reikalavimų ir referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų visoje Sąjungoje ir kiekvienoje prekybos vietoje procentines dalis, kaip nurodyta 1 dalyje.

9 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2018 m. sausio 3 d.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2016 m. birželio 13 d.

Komisijos vardu

Pirmininkas

Jean-Claude JUNCKER

PRIEDAS

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

SIMBOLIS	DUOMENŲ RŪŠIS	APIBRĖŽTIS
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{DECIMAL-n/m}	Dešimtainis skaičius iš viso iki n skaitmenų, iš kurių iki m skaitmenų gali rodyti dalis	Skaitiniame laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės. — dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku), — skaičius gali būti su „-“ (minusu), kai yra neigiamas. Atitinkamais atvejais vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{CURRENCYCODE_3}	3 raidiniai skaitiniai ženklai	Triraidis ISO 4217 valiutos kodas.
{DATEFORMAT}	ISO 8601 datos formatas	Datos turėtų būti pateikiamos šiuo formatu: MMMM-MM-DD.
{ISIN}	12 raidiniai skaitiniai ženklai	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.

2 lentelė

Apimties viršutinės ribos mechanizmo tikslu teikiamų pranešimų forma

Duomenų laukelio pavadinimas	Forma
Ataskaitinis laikotarpis	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} kai pirma data žymi ataskaitinio laikotarpio pradžią, o antra data – ataskaitinio laikotarpio pabaigą
Pranešimą teikiančio subjekto identifikavimas	Kai pranešimą teikia prekybos vieta: {MIC} (segmento MIC kodas arba atitinkamais atvejais veiklos MIC kodas) arba {ALPHANUM-50} kai ataskaitą teikia KIJT
Prekybos vietos identifikatorius	{MIC} (segmento MIC kodas, jei yra, kitu atveju – veiklos MIC kodas)
Priemonės identifikatorius	{ISIN}
Sandorių valiuta	{CURRENCYCODE_3}
Bendra prekybos apimtis (pagal valiutą)	{DECIMAL-18/5}

Duomenų laukelio pavadinimas	Forma
Bendra prekybos apimtis pagal referencinės kainos leidimą netaikyti reikalavimų, kaip apibrėžta FPRR 4 straipsnio 1 dalies a punkte (pagal valiutą)	{DECIMAL-18/5}
Bendra prekybos apimtis pagal suderėtų sandorių leidimą netaikyti reikalavimų, kaip apibrėžta FPRR 4 straipsnio 1 dalies b punkto i papunktyje (pagal valiutą)	{DECIMAL-18/5}