

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/577**(2016. gada 13. jūnijs),****ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par apjoma ierobežošanas mehānismu un informācijas sniegšanu pārredzamības un citu aprēķinu nolūkā****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾ un jo īpaši tās 5. panta 9. punktu un 22. panta 4. punktu,

tā kā:

- (1) Regulā (ES) Nr. 600/2014 ir noteikts, ka kompetentajām iestādēm un Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādei (EVTI) ir jāveic ievērojams skaits aprēķinu, lai pielāgotu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības režīma piemērojamību un tirdzniecības pienākumu attiecībā uz atvasinātiem instrumentiem, kā arī lai noteiktu, vai ieguldījumu brokeru sabiedrība ir sistemātisks internalizētājs.
- (2) Lai veiktu nepieciešamos aprēķinus, gan kompetentajām iestādēm, gan EVTI ir jābūt iespējai iegūt drošus un kvalitatīvus datus par katru aktīvu kategoriju, uz kuru attiecas Regula (ES) Nr. 600/2014. Tādēļ ir jāuzlabo gan piekļuve datiem, gan to datu kvalitāte, kas kompetentajām iestādēm un EVTI ir pieejami saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES ⁽²⁾ un Regulu (ES) Nr. 600/2014, lai pēc tam, kad režīms ir ticis piemērots konkrētu laikposmu, varētu veikt informācijā vairāk pamatotus aprēķinus attiecībā uz finanšu instrumentu klasifikāciju, tostarp attiecībā uz robežvērtībām, ko piemēro pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības nolūkos, un vajadzības gadījumā šo robežvērtību atkārtotas pielāgošanas nolūkā.
- (3) Būtu jānosaka noteikumi, kuros vispārīgā veidā konkretizē kopīgos elementus attiecībā uz tādu datu saturu un formātu, kas tirdzniecības vietām, apstiprinātām publicēšanas struktūrām (APS) un konsolidētu datu lentes nodrošinātājiem (KDLN) ir jāiesniedz pārredzamības un citu aprēķinu nolūkā. Minētie noteikumi būtu jāskata saistībā ar Komisijas Deleģētajām regulām (ES) 2017/587 ⁽³⁾, (ES) 2017/583 ⁽⁴⁾, (ES) 2017/567 ⁽⁵⁾, (ES) 2017/565 ⁽⁶⁾ un (ES) 2016/2020 ⁽⁷⁾, kurās tiek aprakstīta aprēķinu veikšanai nepieciešamā metodika un dati un

⁽¹⁾ OV L 173, 12.6.2014., 84. lpp.⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Direktīva 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/EK un Direktīvu 2011/61/ES (OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp.).⁽³⁾ Komisijas 2016. gada 14. jūlija Deleģētā regula (ES) 2017/587, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par pārredzamības prasībām tirdzniecības vietām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām attiecībā uz akcijām, depozitārajiem sertifikātiem, biržā tirgotiem fondiem, sertifikātiem un citiem līdzīgiem finanšu instrumentiem un par darījumu izpildes prasībām attiecībā uz konkrētām akcijām tirdzniecības vietā vai attiecībā uz sistemātisku internalizētāju (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 387. lpp.).⁽⁴⁾ Komisijas 2016. gada 14. jūlija Deleģētā regula (ES) 2017/583, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par pārredzamības prasībām tirdzniecības vietām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām un atvasinātajiem instrumentiem (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 229. lpp.).⁽⁵⁾ Komisijas 2016. gada 18. maija Deleģētā regula (ES) 2017/567, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz definīcijām, pārredzamību, portfeļa sablīvēšanu un produktu intervences un pozīciju uzraudzības pasākumiem (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 90. lpp.).⁽⁶⁾ Komisijas 2016. gada 25. aprīļa Deleģētā regula (ES) 2017/565, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību organizatoriskām prasībām un darbības nosacījumiem un jēdzienu definīcijām minētās direktīvas mērķiem (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 1. lpp.).⁽⁷⁾ Komisijas 2016. gada 26. maija Deleģētā regula (ES) 2016/2020, ar ko attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par kritērijiem, pēc kuriem nosaka, vai uz atvasinātajiem instrumentiem, uz kuriem attiecas pienākums veikt tīrvērti, būtu jāattiecinā arī pienākums veikt tirdzniecību, papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem (OV L 313, 19.11.2016., 2. lpp.).

konkretizēts pārredzamības aprēķinu veikšanai nepieciešamais saturs un tvērums. Līdz ar to, veicot šādus aprēķinus, iesniedzamo datu saturam, formātam un kvalitātei attiecībā uz tirdzniecības vietām, APS un KDLN būtu jāatbilst piemērojamajai metodikai, kas paredzēta attiecīgajos Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES un Regulas (ES) Nr. 600/2014 īstenošanas aktos.

- (4) Tirdzniecības vietām, APS un KDLN būtu katru dienu jāiesniedz ziņojumi, izņemot iespējamās *ad hoc* informācijas pieprasījumus un aprēķinus, kas jāveic apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā. Ņemot vērā aptverto finanšu instrumentu plašo klāstu un apstrādājamo datu lielo daudzumu, tas, ka ziņojumi tiek sniegti katru dienu, ļauj kompetentajām iestādēm precīzāk apstrādāt pārvaldāma apmēra lietas un nodrošina datu sniegšanas efektīvu un savlaicīgu pārvaldību, datu kvalitatīvu pārbaudi un datu apstrādi. Turklāt datu vākšana katru dienu tirdzniecības vietām, APS un KDLN vienkāršo pienākumu sniegt datus, atbrīvojot tos no sloga, ko rada tirdzniecības dienu skaita aprēķināšana gadījumos, kad ir piemērojams minētais kvantitatīvais likviditātes kritērijs, un no datu apkopošanas attiecībā uz vienu un to pašu finanšu instrumentu dažādās laika termiņu grupās gadījumos, kad ir jāņem vērā līdz termiņam atlikušais laiks. Centralizējot minēto aprēķināšanu, tiek arī nodrošināts, ka kritērijus izmanto konsekventi attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem un tirdzniecības vietām.
- (5) Tirdzniecības vietām būtu jāglabā dati, kas ir vispusīgi un ļauj kompetentajām iestādēm un EVTI veikt precīzus aprēķinus. Kaut gan nepieciešamo informāciju parasti sniedz pēctirdzniecības ziņojumos, dažos gadījumos aprēķiniem ir vajadzīga smalkāka informācija nekā tā, kas ir pieejama minētajos ziņojumos. Tas ietver, piemēram, informāciju par darījumiem, kas izpildīti uz rīkojumu pamata un kas guvuši labumu no liela apjoma atbrīvojuma. Šī informācija nebūtu jāiekļauj tirdzniecības ziņojumos, jo tā varētu pakļaut šādus darījumus negatīvai tirgus ietekmei. Tomēr, tā kā šī informācija varētu būt nepieciešama kompetentajām iestādēm, lai veiktu precīzus aprēķinus, tirdzniecības vietām, APS un KDLN tā būtu pienācīgi jāuzglabā un vajadzības gadījumā jādara zināma kompetentajām iestādēm un EVTI. Tirdzniecības vietām būtu jānodrošina, ka tās atbilstoši izplata informāciju, kas ir jāsniedz kompetentajām iestādēm un EVTI. Ziņojumos, ko tās sniedz KDLN, būtu pienācīgi jānorāda darījumi, kas izpildīti uz liela apjoma rīkojumu pamata.
- (6) Dati būtu jāvēl no dažādiem avotiem, jo vienam avotam, iespējams, ne vienmēr ir pilnīgs datu kopums par aktīvu kategoriju vai pat konkrētu instrumentu. Tāpēc, ar mērķi dot iespēju kompetentajām iestādēm un EVTI iegūt un apkopot augstas kvalitātes datus no dažādiem avotiem, ja iespējams, tirdzniecības vietām, APS un KDLN būtu jāizmanto iepriekš noteiktas specifikācijas attiecībā uz saturu un formātu, lai atvieglotu datu vākšanu un padarītu to izmaksu ziņā efektīvāku.
- (7) Ņemot vērā nepieciešamo aprēķinu sensitivitāti un iespējamās komerciālās sekas tirdzniecības vietām, emitentiem un citiem tirgus dalībniekiem, publicējot nepareizu informāciju, kā rezultātā apjoma ierobežošanas mehānisma gadījumā varētu tikt apturēta atbrīvojumu izmantošana attiecībā uz vienu konkrētu tirdzniecības vietu vai visā Savienībā attiecībā uz vienu konkrētu finanšu instrumentu, ir būtiski precizēt kompetentajām iestādēm un EVTI iesniedzamo datu formātu, lai izveidotu efektīvus saziņas kanālus ar tirdzniecības vietām un KDLN un nodrošinātu pieprasīto datu savlaicīgu un pareizu publicēšanu.
- (8) Regulā (ES) Nr. 600/2014 ir noteikts, ka EVTI attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem piemēro apjoma ierobežošanas mehānismu, ir jāpublicē aprēķini par kopējo tirdzniecības apjomu iepriekšējo 12 mēnešu laikā un procentuālo daļu tirdzniecībai, kas veikta saskaņā ar nolīgto tirdzniecību un salīdzināmās cenas atbrīvojumiem, visā Savienībā un katrā tirdzniecības vietā iepriekšējo 12 mēnešu laikā. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kas tiek tirgoti vairāk nekā vienā valūtā, apjoms, kas izpildīts dažādās valūtās, ir jākonvertē vienā kopīgā valūtā, lai varētu sarēķināt šo apjomu un lai veiktu nepieciešamos aprēķinus. Tāpēc būtu jāparedz metodika un valūtas maiņas kurss, kas jāizmanto, lai vajadzības gadījumā konvertētu tirdzniecības apjomu.
- (9) Apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā būtu jānosaka prasība, ka tirdzniecības vietas iesniedz ziņojumus par tirdzniecības apjomu, kas izpildīts saskaņā ar salīdzināmās cenas atbrīvojumiem un – attiecībā uz likvidiem instrumentiem – saskaņā ar nolīgto tirdzniecības atbrīvojumu. Ņemot vērā to, ka atbrīvojumus piemēro rīkojumiem, nevis darījumiem, ir svarīgi precizēt, ka paziņojamajā apjomā būtu jāietver visi darījumi, kas iezīmēti ar "RFPT" vai "NLIQ", attiecībā uz darījumu pēctirdzniecības publicēšanu un kā noteikts Deleģētajā regulā (ES) 2017/587. Ja darījums tika izpildīts, pamatojoties uz diviem rīkojumiem, kas gūst labumu no liela apjoma atbrīvojuma, šo darījumu nebūtu jāiekļauj apjomā, ko aprēķina saskaņā ar salīdzināmās cenas atbrīvojumu un nolīgto tirdzniecības atbrīvojumu.
- (10) Apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā tirdzniecības vietām un KDLN būtu jānodrošina, lai tirdzniecības vieta, kurā darījums tika izpildīts, tiek identificēta pietiekami detalizēti, lai EVTI varētu veikt visus Regulā (ES)

Nr. 600/2014 minētos aprēķinus. Konkrētāk, izmantotajam tirdzniecības vietas identifikatoram vajadzētu būt unikālam attiecībā uz šo tirdzniecības vietu, un tam nevajadzētu būt kopīgam ar citām tirdzniecības vietām, kuras pārvalda tas pats tirgus operators. Tirdzniecības vietas identifikatoriem būtu jāļauj EVTI nepārprotami atšķirt visas tirdzniecības vietas, attiecībā uz kurām tirgus operators ir saņēmis īpašu atļauju saskaņā ar Direktīvu 2014/65/ES.

- (11) Apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā ir jānosaka prasība tirdzniecības vietām pirmo ziņojumu iesniegt dienā, kad sāk piemērot Direktīvu 2014/65/ES un Regulu (ES) Nr. 600/2014, norādot tirdzniecības apjomu saskaņā ar salīdzināmās cenas atbrīvojumiem un – attiecībā uz likvidiem instrumentiem – saskaņā ar nolīgto tirdzniecības atbrīvojumu par iepriekšējo kalendāro gadu. Lai nodrošinātu šīs prasības samērīgu piemērošanu, tirdzniecības vietām būtu šajā nolūkā jābalsta savs ziņojums uz pielāgoto tirdzniecības apjomu, kas izpildīts saskaņā ar līdzvērtīgiem atbrīvojumiem, kuri ir spēkā atbilstīgi Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvai 2004/39/EK ⁽¹⁾ un Komisijas Regulai (EK) Nr. 1287/2006 ⁽²⁾.
- (12) Lai sniegtu kompetentajām iestādēm un EVTI precīzus datus, tirdzniecības vietām, APS un KDLN būtu jānodrošina, ka tie ziņojumos iekļauj tikai vienreiz uzskaitītus darījumus.
- (13) Šīs regulas noteikumi ir cieši saistīti, jo tie attiecas uz datu pieprasījumu saturu, biežumu un formātu, šo datu apstrādei izmantojamo metodi un citām specifikācijām attiecībā uz informācijas publicēšanu pārredzamības nolūkā, kā noteikts Regulā (ES) Nr. 600/2014. Lai nodrošinātu saskaņotību starp minētajiem noteikumiem, kas stāties spēkā vienlaikus, un lai sekmētu vispusīgu priekšstatu ieinteresētajām personām un jo īpaši tām, uz kurām attiecas šie pienākumi, ir vēlams tos iekļaut vienā regulā.
- (14) Konsekvences labad un lai nodrošinātu finanšu tirgu netraucētu darbību, ir nepieciešams noteikt, ka šajā regulā paredzētos noteikumus un Regulā (ES) Nr. 600/2014 paredzētos noteikumus piemēro no tās pašas dienas.
- (15) Šī regula balstās uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko EVTI iesniegusi Komisijai.
- (16) EVTI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanos par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu izveidotās Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu ⁽³⁾,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Priekšmets un piemērošanas joma

1. Šajā regulā ir noteikta sīkāka informācija par kompetento iestāžu nosūtāmajiem datu pieprasījumiem un sīkāka informācija par tirdzniecības vietu, apstiprinātu publicēšanas struktūru (APS) un konsolidētu datu lentes nodrošinātāju (KDLN) nosūtāmo atbildi uz šiem pieprasījumiem, lai aprēķinātu un pielāgotu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības un tirdzniecības pienākuma režīmus un jo īpaši lai noteiktu šādus faktorus:

- a) vai kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem, kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgiem finanšu instrumentiem un finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, ir likvīds tirgus;
- b) pirmstirdzniecības pārredzamības atbrīvojumu robežvērtības attiecībā uz kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem, kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgiem finanšu instrumentiem un finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2004. gada 21. aprīļa Direktīva 2004/39/EK, kas attiecas uz finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Padomes Direktīvas 85/611/EEK un 93/6/EEK un Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2000/12/EK un atceļ Padomes Direktīvu 93/22/EEK (OV L 145, 30.4.2004., 1. lpp.).

⁽²⁾ Komisijas 2006. gada 10. augusta Regula (EK) Nr. 1287/2006, ar ko īsteno Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2004/39/EK attiecībā uz ieguldījumu sabiedrību pienākumu vest uzskaiti, darījumu pārskatu sniegšanu, tirgus pārskatāmību, finanšu instrumentu pielaidi tirdzniecībai un šajā direktīvā definētajiem termiņiem (OV L 241, 2.9.2006., 1. lpp.).

⁽³⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

- c) pēctirdzniecības pārredzamības atlikšanas robežvērtības attiecībā uz kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem, kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgiem finanšu instrumentiem un finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti;
- d) kad finanšu instrumentu kategorijas likviditāte vairs nesasniedz paredzēto robežvērtību;
- e) vai ieguldījumu brokeru sabiedrība ir sistemātisks internalizētājs;
- f) standarta tirgus apmēru, kas piemērojams sistemātiskiem internalizētājiem, kuri tirgo kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentus un kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgus finanšu instrumentus, un instrumentam raksturīgo apmēru, kas piemērojams sistemātiskiem internalizētājiem, kuri tirgo finanšu instrumentus, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti;
- g) attiecībā uz kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem un kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgiem finanšu instrumentiem – kopējais tirdzniecības apjoms pēdējo 12 mēnešu laikā un procentuālā daļa tādai tirdzniecībai, kas veikta saskaņā ar nolīgto tirdzniecību un salīdzināmās cenas atbrīvojumiem, visā Savienībā un katrā tirdzniecības vietā iepriekšējo 12 mēnešu laikā;
- h) vai atvasinātie instrumenti ir pietiekami likvīdi, lai īstenotu tirdzniecības pienākumu attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem.

2. pants

Datu pieprasījumu saturs un paziņojamā informācija

1. Lai veiktu aprēķinus iepriekš noteiktos datumos vai iepriekš noteiktā biežumā, tirdzniecības vietām, APS un KDLN būtu kompetentajām iestādēm jāsniedz visi dati, kas nepieciešami, lai veiktu aprēķinus, kas paredzēti šādās regulās:
 - a) Deleģētā regula (ES) 2017/587;
 - b) Deleģētā regula (ES) 2017/583;
 - c) Deleģētā regula (ES) 2017/567;
 - d) Deleģētā regula (ES) 2017/565.
2. Kompetentās iestādes vajadzības gadījumā var pieprasīt tirdzniecības vietām, APS un KDLN sniegt papildu informāciju, lai uzraudzītu un pielāgotu robežvērtības un parametrus, kas minēti 1. panta a) līdz f) punktā un h) punktā.
3. Kompetentās iestādes var pieprasīt visus datus, kas EVTI ir jāņem vērā saskaņā ar Deleģēto regulu (ES) 2016/2020, attiecībā uz finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, tostarp šādus datus:
 - a) vidējais tirdzniecības biežums;
 - b) vidējais tirdzniecības apmērs un sadalījums;
 - c) tirgus dalībnieku skaits un veids;
 - d) vidējais starpības apmērs.

3. pants

Datu pieprasījumu biežums un laikposms, kādā tirdzniecības vietas, APS un KDLN sniedz atbildes

1. Tirdzniecības vietas, APS un KDLN katru dienu iesniedz 2. panta 1. punktā minētos datus.
2. Tirdzniecības vietas, APS un KDLN iesniedz datus, atbildot uz ad hoc pieprasījumu, kā minēts 2. panta 2. punktā, četru nedēļu laikā pēc minētā pieprasījuma saņemšanas, ja vien ārkārtas apstākļu dēļ atbilde nav vajadzīga īsākā laika periodā, kā norādīts pieprasījumā.
3. Atkāpjoties no 1. un 2. punkta, tirdzniecības vietas un KDLN iesniedz datus, kas izmantojami apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā, kā izklāstīts 6. panta 6. līdz 9. punktā.

*4. pants***Datu pieprasījumu formāts**

Tirdzniecības vietas, APS un KDLN iesniedz 2. panta minētos datus kopējā XML formātā un, ja iespējams, saskaņā ar jebkuru citu noteikto specifikāciju attiecībā uz saturu un formātu, lai sekmētu efektīvu un automatizētu datu piegādes procesu, kā arī to apkopošanu ar līdzīgiem datiem no citiem avotiem.

*5. pants***Glabājamo datu veidi un minimālais laikposms, kādā tirdzniecības vietas, APS un KDLN glabā datus**

1. Tirdzniecības vietas, APS un KDLN glabā visus datus, kas nepieciešami, lai aprēķinātu, uzraudzītu vai pielāgotu 2. pantā noteiktās robežvērtības un parametrus neatkarīgi no tā, vai šī informācija ir publiskota vai nē.
2. Tirdzniecības vietas, APS un KDLN glabā 1. punktā minētos datus vismaz trīs gadus.

*6. pants***Tirdzniecības vietu un KDLN ziņošanas prasības apjoma ierobežošanas mehānisma vajadzībām**

1. Attiecībā uz katru finanšu instrumentu, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 3. pantā noteiktās pārredzamības prasības, tirdzniecības vietas kompetentajai iestādei iesniedz šādus datus:
 - a) kopējais finanšu instrumenta tirdzniecības apjoms, kas ir izpildīts attiecīgajā tirdzniecības vietā;
 - b) kopējais finanšu instrumenta tirdzniecības apjoms, kurš ir izpildīts attiecīgajā tirdzniecības vietā un uz kuru attiecas atbrīvojumi, kas noteikti Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā vai 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā, attiecīgi norādot kopējo apjomu attiecībā uz katru atbrīvojumu.
2. Attiecībā uz katru finanšu instrumentu, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 3. pantā noteiktās pārredzamības prasības, un ja to pieprasa kompetentā iestāde, KDLN kompetentajai iestādei iesniedz šādus datus:
 - a) kopējais finanšu instrumenta tirdzniecības apjoms, kas ir izpildīts visās tirdzniecības vietās Savienībā, atsevišķi norādot kopējo apjomu attiecībā uz katru tirdzniecības vietu;
 - b) kopējais tirdzniecības apjoms, kurš ir izpildīts visās tirdzniecības vietās Savienībā un uz kuru attiecas atbrīvojumi, kas noteikti Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā vai 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā, attiecīgi norādot kopējo apjomu attiecībā uz katru atbrīvojumu un katru tirdzniecības vietu.
3. Tirdzniecības vietas un KDLN kompetentajai iestādei sniedz 1. un 2. punktā noteiktos datus, izmantojot pielikumā minētos formātus. Tie jo īpaši nodrošina, ka to sniegtie tirdzniecības vietas identifikatori ir pietiekami detalizēti, lai ļautu kompetentajai iestādei un EVTI apzināt tirdzniecības apjomu, kas izpildīts saskaņā ar salīdzināmās cenas atbrīvojumiem un – attiecībā uz likvīdiem instrumentiem – saskaņā ar nolīgto tirdzniecības atbrīvojumu katrai tirdzniecības vietai, un lai varētu veikt aprēķinus par attiecību, kas noteikta Regulas (ES) Nr. 600/2014 5. panta 1. punkta a) apakšpunktā.
4. Lai aprēķinātu 1. un 2. punktā minēto apjomu:
 - a) atsevišķa darījuma apjomu nosaka, reizinot finanšu instrumenta cenu ar tirgots vienību skaitu;
 - b) kopējo 1. punkta a) apakšpunktā un 2. punkta a) apakšpunktā minēto katra finanšu instrumenta tirdzniecības apjomu nosaka, summējot visu atsevišķo un vienreiz uzskaitīto darījumu apjomu attiecībā uz minēto finanšu instrumentu;
 - c) šā panta 1. punkta b) apakšpunktā un 2. punkta b) apakšpunktā minēto tirdzniecības apjomu nosaka, summējot visu atsevišķo un vienreiz uzskaitīto darījumu apjomu attiecībā uz minēto finanšu instrumentu, par ko ziņo ar marķējumu “salīdzināmā cena” un “nolīgti darījumi ar likvīdiem finanšu instrumentiem” saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/587 I pielikuma 4. tabulu.

5. Tirdzniecības vietas un KDLN summē vienīgi darījumus, kas izpildīti tajā pašā valūtā un sniedz atsevišķu ziņojumu par katru summēto apjomu darījumiem izmantotajā valūtā.
6. Tirdzniecības vietas kompetentajai iestādei sniedz 1.–5. punktā minētos datus katra kalendārā mēneša pirmajā un sešpadsmitajā dienā līdz plkst. 13.00 pēc Viduseiropas laika. Ja kalendārā mēneša pirmā vai sešpadsmitā diena tirdzniecības vietai nav darba diena, tirdzniecības vieta sniedz datus kompetentajai iestādei līdz nākamās dienas plkst. 13.00 pēc Viduseiropas laika.
7. Tirdzniecības vietas kompetentajai iestādei iesniedz datus par kopējo tirdzniecības apjomu, kas noteikts saskaņā ar 1.–5. punktu attiecībā uz šādiem laikposmiem:
- a) attiecībā uz ziņojumiem, kas jāiesniedz katra kalendārā mēneša sešpadsmitajā dienā – izpildes laikposms ir no tā paša kalendārā mēneša pirmās dienas līdz piecpadsmitajai dienai;
 - b) attiecībā uz ziņojumiem, kas jāiesniedz katra kalendārā mēneša pirmajā dienā – izpildes laikposms ir no iepriekšējā kalendārā mēneša sešpadsmitās dienas līdz iepriekšējā kalendārā mēneša pēdējai dienai.
8. Atkāpjoties no 6. un 7. punkta, tirdzniecības vietas iesniedz pirmo ziņojumu par katru finanšu instrumentu dienā, kad sāk piemērot Direktīvu 2014/65/ES un Regulu (ES) Nr. 600/2014, līdz plkst. 13.00 pēc Viduseiropas laika, iekļaujot datus par tirdzniecības apjomu, kas minēts 1. punktā, par iepriekšējo kalendāro gadu. Šajā nolūkā tirdzniecības vietas atsevišķi par katru kalendāro mēnesi sniedz šādus datus:
- a) tirdzniecības apjoms laikposmā no katra kalendārā mēneša pirmās dienas līdz piecpadsmitajai dienai;
 - b) tirdzniecības apjoms laikposmā no katra kalendārā mēneša sešpadsmitās dienas līdz katra kalendārā mēneša pēdējai dienai.
9. Tirdzniecības vietas un KDLN sniedz atbildi uz jebkuru *ad hoc* pieprasījumu, ko iesniegušas kompetentās iestādes, par tirdzniecības apjomu saistībā ar aprēķinu, kas jāveic, lai uzraudzītu, kā tiek izmantoti salīdzināmās cenas vai nolīgti tirdzniecības atbrīvojumi, līdz nākamās darba dienas beigām pēc tās dienas, kad tika iesniegts pieprasījums.

7. pants

Kompetento iestāžu EVTI ziņošanas prasības apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā un tirdzniecības pienākums attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem

1. Kompetentās iestādes sniedz EVTI datus, kas saņemti no tirdzniecības vietas vai KDLN saskaņā ar 6. pantu līdz plkst. 13.00 pēc Viduseiropas laika nākamajā darba dienā pēc to saņemšanas.
2. Kompetentās iestādes sniedz EVTI datus, kas saņemti no tirdzniecības vietas, APS vai KDLN, lai noteiktu, vai atvasinātie instrumenti ir pietiekami likvīdi, kā noteikts 1. panta h) punkta, bez nepamatotas kavēšanās un ne vēlāk kā trīs darba dienu laikā pēc attiecīgo datu saņemšanas.

8. pants

EVTI ziņošanas prasības apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā

1. EVTI publicē aprēķinus par katra finanšu instrumenta tirdzniecības kopējo apjomu iepriekšējo 12 mēnešu laikā un procentuālo daļu tādai tirdzniecībai, kas veikta saskaņā gan ar nolīgto tirdzniecību, gan ar salīdzināmās cenas atbrīvojumiem, visā Savienībā un katrā tirdzniecības vietā iepriekšējo 12 mēnešu laikā atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 600/2014 5. panta 4., 5. un 6. punktam, ne vēlāk kā plkst. 22.00 pēc Viduseiropas laika piektajā darb dienā pēc ziņošanas periodu beigām, kas noteikts šīs regulas 6. panta 6. punktā.
2. 1. punktā minētā publikācija ir bez maksas un ir mašīnlasāmā un cilvēkklasāmā formātā, kā definēts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/571 ⁽¹⁾ 14. pantā un Deleģētās regulas (ES) 2017/567 13. panta 4. un 5. punktā.

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 2. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/571, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par atļauju izsniegšanu, organizatoriskām prasībām un darījumu publicēšanu attiecībā uz datu ziņošanas pakalpojumu sniedzējiem (skatīt šā Oficiālā Vēstneša 126. lpp.).

3. Ja finanšu instrumentu tirgo vairāk nekā vienā valūtā visā Savienībā, EVTI visu apjomu konvertē euro, izmantojot vidējos valūtas maiņas kursus, kas aprēķināti, pamatojoties uz dienas euro valūtas maiņas atsauces kursiem, ko Eiropas Centrālā banka savā tīmekļa vietnē publicējusi iepriekšējo 12 mēnešu laikā. Minēto konvertēto apjomu izmanto, lai aprēķinātu un publicētu kopējo tirdzniecības apjomu un procentuālo daļu tādai tirdzniecībai, kas veikta saskaņā gan ar nolīgto tirdzniecību, gan ar salīdzināmās cenas atbrīvojumiem, visā Savienībā un katrā tirdzniecības vietā, kā minēts 1. punktā.

9. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

To piemēro no 2018. gada 3. janvāra.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2016. gada 13. jūnijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNKER

PIELIKUMS

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
{ALPHANUM-n}	Līdz n burtciparu zīmēm	Brīvas formas teksta lauks.
{DECIMAL-n/m}	Decimālskaitlis, kas sastāv no maksimāli n zīmēm, no kurām maksimāli m zīmes var būt cipari aiz komata	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām vērtībām. — decimāldaļas atdala ar “,” (komats), — skaitlim priekšā var būt norādīta “-” (mīnusa zīme), lai norādītu negatīvus skaitļus. Attiecīgā gadījumā vērtības noapaļo un nesaīsina.
{CURRENCYCODE_3}	3 burtciparu zīmes	Valūtas trīsburtu kods, kā definēts ISO 4217.
{DATEFORMAT}	Datuma formāts saskaņā ar ISO 8601	Datumus norāda šādā formātā: GGGG-MM-DD.
{ISIN}	12 burtciparu zīmes	ISIN kods, kā definēts ISO 6166.
{MIC}	4 burtciparu zīmes	Tirgus identifikators, kas definēts ISO 10383.

2. tabula

Ziņojuma formāts apjoma ierobežošanas mehānisma nolūkā

Datu lauka nosaukums	Formāts
Pārskata periods	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} Pirmais datums ir pārskata perioda sākums un otrais datums ir pārskata perioda beigas.
Pārskata sniedzēja vienības kods	Ja pārskata sniedzēja vienība ir tirdzniecības vieta: {MIC} (segmenta MIC vai attiecīgā gadījumā darbības MIC) vai {ALPHANUM-50}, ja pārskata sniedzēja vienība ir KDLN.
Tirdzniecības vietas identifikators	{MIC} (ja pieejams, segmenta MIC, pretējā gadījumā darbības MIC).
Instrumenta identifikators	{ISIN}
Darījuma valūta	{CURRENCYCODE_3}
Kopējais tirdzniecības apjoms (uz katru valūtu)	{DECIMAL-18/5}

Datu lauka nosaukums	Formāts
Kopējais tirdzniecības apjoms saskaņā ar salīdzināmās cenas atbrīvojumu, kā noteikts FITR 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā (uz katru valūtu)	{DECIMAL-18/5}
Kopējais tirdzniecības apjoms saskaņā ar nolīgto darījumu atbrīvojumu, kā noteikts FITR 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā (uz katru valūtu)	{DECIMAL-18/5}