

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2017/577**z 13. júna 2016,****ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa mechanizmu objemového prahu a poskytovania informácií na účely výpočtu transparentnosti a iných výpočtov****(Text s významom pre EHP)**

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a najmä na jeho článok 5 ods. 9 a článok 22 ods. 4,

keďže:

- (1) V nariadení EÚ č. 600/2014 sa vyžaduje, aby príslušné orgány a Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA) vykonali značný počet výpočtov s cieľom nastaviť uplatniteľnosť režimu predobchodnej a poobchodnej transparentnosti a obchodovacej povinnosti pre deriváty, ako aj s cieľom určiť, či je investičná spoločnosť systematickým internalizátorom.
- (2) Na to, aby príslušné orgány a orgán ESMA mohli vykonávať potrebné výpočty, musia mať možnosť získavať spoľahlivé a vysokokvalitné údaje pre každú triedu aktív, na ktorú sa vzťahuje nariadenie (EÚ) č. 600/2014. Je preto potrebné zlepšiť prístupnosť, ako aj kvalitu údajov, ktoré sú dostupné pre príslušné orgány a orgán ESMA v súlade so smernicou Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ ⁽²⁾ a nariadením (EÚ) č. 600/2014, aby sa klasifikácia finančných nástrojov vrátane prahových hodnôt na účely predobchodnej a poobchodnej transparentnosti a v prípade potreby opätovného stanovenia týchto prahových hodnôt dala vypočítať na základe väčšieho množstva informácií získaných po uplynutí určitého obdobia, počas ktorého sa tento režim uplatňoval.
- (3) Je potrebné prijať ustanovenia, v ktorých sa vo všeobecnosti stanovujú spoločné prvky týkajúce sa obsahu a formátu údajov, ktoré majú predkladať obchodné miesta, schválené mechanizmy zverejňovania (APA) a poskytovatelia konsolidovaného informačného systému (CTP) na účely výpočtu transparentnosti a iných výpočtov. Tieto ustanovenia by sa mali vykladať spolu s delegovanými nariadeniami Komisie (EÚ) 2017/587 ⁽³⁾, (EÚ) 2017/583 ⁽⁴⁾, (EÚ) 2017/567 ⁽⁵⁾, (EÚ) 2017/565 ⁽⁶⁾ a (EÚ) 2016/2020 ⁽⁷⁾, v ktorých sa opisuje metodika a údaje potrebné na vykonanie príslušných výpočtov a stanovuje sa obsah a rozsah údajov potrebných na vykonanie

⁽¹⁾ Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 84.

⁽²⁾ Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorou sa mení smernica 2002/92/ES a smernica 2011/61/EÚ (Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 349).

⁽³⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/587 zo 14. júla 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa požiadaviek na transparentnosť pre obchodné miesta a investičné spoločnosti v súvislosti s akciami, vkladovými potvrdenkami, fondmi obchodovanými na burze, certifikátmi a inými podobnými finančnými nástrojmi, ako aj povinnosti vykonania transakcií s určitými akciami na obchodnom mieste alebo prostredníctvom systematického internalizátora (pozri stranu 387 tohto úradného vestníka).

⁽⁴⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/583 zo 14. júla 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa požiadaviek na transparentnosť pre obchodné miesta a investičné spoločnosti v súvislosti s dlhopismi, štruktúrovanými finančnými produktmi, emisnými kvótami a derivátmi (pozri stranu 229 tohto úradného vestníka).

⁽⁵⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/567 z 18. mája 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o vymedzenia pojmov, transparentnosť, kompresiu portfólia a opatrenia dohľadu nad zasahovaním do produktov a pozícií (pozri stranu 90 tohto úradného vestníka).

⁽⁶⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/565 z 25. apríla 2016, ktorým sa dopĺňa smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ, pokiaľ ide o organizačné požiadavky a podmienky výkonu činnosti investičných spoločností, ako aj o vymedzené pojmy na účely uvedenej smernice (pozri stranu 1 tohto úradného vestníka).

⁽⁷⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2016/2020 z 26. mája 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy pre kritériá na určenie toho, či by sa na deriváty podliehajúce zúčtovacej povinnosti mala vzťahovať obchodovacia povinnosť (Ú. v. EÚ L 313, 19.11.2016, s. 2).

výpočtov transparentnosti. Obsah, formát a kvalita údajov predložených v súvislosti s obchodnými miestami, APA a CTP by preto pri vykonávaní týchto výpočtov mali byť v súlade s príslušnou metodikou stanovenou v príslušných vykonávacích aktoch smernice 2014/65/EÚ a nariadenia (EÚ) č. 600/2014.

- (4) S výnimkou možných ad hoc žiadostí o poskytnutie údajov a výpočtov, ktoré sa majú vykonať na účely mechanizmu objemového prahu, musia obchodné miesta, APA a CTP predkladať správy každý deň. Vzhľadom na široký rozsah finančných nástrojov, ktorých sa to týka, a veľké množstvo údajov, ktoré sa majú spracovať, toto každodenné predkladanie umožní príslušným orgánom presnejšie spracúvať spisy zvláduteľnej veľkosti a zabezpečiť účinnú a včasnú správu predložených údajov, kontrolu kvality údajov a spracovanie údajov. Každodenný zber údajov takisto zjednoduší povinnosť obchodných miest, APA a CTP poskytovať údaje tým, že ich oslobodí od nutnosti vypočítavať počet obchodných dní v prípadoch, na ktoré sa vzťahuje kritérium kvantitatívnej likvidity, a zhromažďovať údaje o tom istom finančnom nástroji naprieč rôznymi časovými skupinami splatností v prípadoch, keď je nutné zohľadniť čas splatnosti. Centralizovaním tohto výpočtu sa takisto zabezpečí dôsledné používanie kritérií naprieč finančnými nástrojmi a obchodnými miestami.
- (5) Obchodné miesta by mali uchovávať údaje, ktoré sú komplexné a umožňujú príslušným orgánom a orgánu ESMA vykonať presné výpočty. Hoci požadované informácie sa vo všeobecnosti poskytujú v poobchodných správach, v niektorých prípadoch sú na výpočty potrebné informácie nad rámec informácií dostupných v týchto správach. To zahŕňa napríklad informácie o transakciách vykonaných na základe pokynov, ktoré využili výnimku z dôvodu veľkého rozsahu. Tieto informácie by nemali byť zahrnuté do obchodných správ, lebo by tieto transakcie mohli vystaviť nepriaznivému vplyvu trhu. Keďže však príslušné orgány môžu potrebovať tieto informácie na vykonanie presných výpočtov, obchodné miesta, APA a CTP by ich mali primerane uchovávať a podľa potreby oznámiť príslušným orgánom a orgánu ESMA. Obchodné miesta by mali zaistiť náležité šírenie informácií, ktoré sa majú poskytnúť príslušným orgánom a orgánu ESMA. Transakcie vykonané na základe pokynov vo veľkom rozsahu by mali byť v ich správe pre CTP primerane označené.
- (6) Údaje by sa mali zbierať z rôznych zdrojov, keďže jediný zdroj nemusí mať vždy k dispozícii úplný súbor údajov pre triedu aktív či dokonca pre konkrétny nástroj. Obchodné miesta, APA a CTP by preto mali využívať vopred stanovené špecifikácie obsahu a formátu, ak sú k dispozícii, čo príslušným orgánom a orgánu ESMA umožní získavať a konsolidovať kvalitné údaje z rôznych zdrojov, a zjednodušiť a zefektívniť tak zber údajov.
- (7) Vzhľadom na citlivosť potrebných výpočtov a potenciálne komerčné dôsledky zverejnenia nesprávnych informácií pre obchodné miesta, emitentov a iných účastníkov trhu, ktoré by v prípade mechanizmu objemového prahu mohli viesť k pozastaveniu využívania výnimky pre jedno konkrétne miesto alebo v celej Únii pre jeden konkrétny finančný nástroj, je dôležité spresniť formát údajov, ktoré sa majú predkladať príslušným orgánom a orgánu ESMA s cieľom vytvoriť účinné komunikačné kanály s obchodnými miestami a CTP a zabezpečiť včasné a správne zverejňovanie požadovaných údajov.
- (8) V nariadení (EÚ) č. 600/2014 sa od orgánu ESMA požaduje, aby v prípade finančných nástrojov, na ktoré sa vzťahuje mechanizmus objemového prahu, zverejnil údaje o celkovom objeme obchodovania počas predchádzajúcich 12 mesiacov a percentuálnom podiele obchodov, pri ktorých sa využívajú výnimky z dohodnutého obchodu aj z referenčnej ceny, a to za celú Úniu i za jednotlivé obchodné miesta počas predchádzajúcich 12 mesiacov. V prípade finančných nástrojov, s ktorými sa obchoduje vo viacerých menách, je potrebné previesť objemy vykonané v rôznych menách na jednu spoločnú menu, aby bolo možné vypočítať tieto objemy a vykonať požadované výpočty. Je preto potrebné stanoviť metodiku a výmenné kurzy, ktoré sa budú používať na prípadný prevod obchodovaných objemov.
- (9) Na účel mechanizmu objemového prahu by obchodné miesta mali byť povinné oznamovať objemy obchodovania vykonaných s využitím výnimky z referenčnej ceny a pre likvidné nástroje aj s využitím výnimky z dohodnutého obchodu. Vzhľadom na to, že výnimky sa vzťahujú na pokyny a nie na transakcie, je dôležité objasniť, že objemy, ktoré sa majú oznamovať, by mali obsahovať všetky transakcie označené ako „RFPT“ alebo „NLIQ“ na účel poobchodného zverejnenia transakcií a v súlade s delegovaným nariadením (EÚ) 2017/587. Ak sa transakcia vykonala na základe dvoch pokynov s využitím výnimky z dôvodu veľkého rozsahu, táto transakcia by sa nemala započítavať do objemov vypočítaných na základe výnimiek z referenčnej ceny a z dohodnutého obchodu.
- (10) Na účel mechanizmu objemového prahu by obchodné miesta a CTP mali zabezpečiť dostatočne podrobnú identifikáciu obchodného miesta, na ktorom bola transakcia vykonaná, aby tak orgán ESMA mohol vykonať všetky

výpočty uvedené v nariadení (EÚ) č. 600/2014. Identifikátor obchodného miesta by najmä mal byť jediný pre dané obchodné miesto, ktoré by sa oň nemalo deliť so žiadnym iným obchodným miestom prevádzkovaným tým istým organizátorom trhu. Identifikátory obchodných miest by mali orgánu ESMA umožniť jednoznačným spôsobom rozlíšiť všetky obchodné miesta, pre ktoré dostal organizátor trhu osobitné povolenie podľa smernice 2014/65/EÚ.

- (11) Na účely mechanizmu objemového prahu je nutné od obchodných miest vyžadovať, aby prvú správu predložili v deň nadobudnutia účinnosti smernice 2014/65/EÚ a nariadenia (EÚ) č. 600/2014 s uvedením obchodovaných objemov, na ktoré sa vzťahuje výnimka z referenčnej ceny, a v prípade likvidných finančných nástrojov výnimka z dohodnutej transakcie, za predchádzajúci kalendárny rok. Na zabezpečenie primeraného uplatňovania tejto požiadavky by obchodné miesta na uvedený účel mali vo svojich správach vychádzať z upravených objemov obchodovania vykonaných s využitím rovnocenných výnimiek uvedených v smernici Európskeho parlamentu a Rady 2004/39/ES ⁽¹⁾ a nariadení Komisie (ES) č. 1287/2006 ⁽²⁾.
- (12) S cieľom poskytovať príslušným orgánom a orgánu ESMA presné údaje by obchodné miesta, APA a CTP mali zabezpečiť, aby ich správy obsahovali len transakcie započítané z jednej strany.
- (13) Ustanovenia tohto nariadenia sú úzko prepojené, lebo sa týkajú vymedzenia obsahu, frekvencie a formátu žiadostí o poskytnutie údajov, metódy, ktorá sa má používať na spracovanie týchto údajov, a ďalších špecifikácií týkajúcich sa zverejňovania informácií na účely transparentnosti podľa nariadenia (EÚ) č. 600/2014. V záujme zabezpečenia súdržnosti medzi týmito ustanoveniami, ktoré nadobudnú účinnosť v rovnakom čase, a s cieľom umožniť komplexný pohľad pre zainteresované strany, najmä pre tie, na ktoré sa tieto povinnosti vzťahujú, je žiaduce zoskupiť ich do jedného nariadenia.
- (14) Z dôvodu jednotnosti a s cieľom zabezpečiť hladké fungovanie finančných trhov je nevyhnutné, aby sa ustanovenia tohto nariadenia a ustanovenia stanovené v nariadení (EÚ) č. 600/2014 uplatňovali od toho istého dátumu.
- (15) Toto nariadenie vychádza z návrhu regulačných technických predpisov, ktoré orgán ESMA predložil Komisii.
- (16) Orgán ESMA uskutočnil otvorené verejné konzultácie o návrhu regulačných technických predpisov, z ktorých toto nariadenie vychádza, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o stanovisko skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov vytvorenú na základe článku 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 ⁽³⁾,

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Predmet úpravy a rozsah pôsobnosti

1. Týmto nariadením sa stanovujú podrobnosti žiadostí o poskytnutie údajov, ktoré majú zasielať príslušné orgány, a podrobnosti odpovedí na tieto žiadosti, ktoré majú zasielať obchodné miesta, schválené mechanizmy zverejňovania (APA) a poskytovatelia konsolidovaného informačného systému (CTP) na účely výpočtu a úpravy režimov predobchodnej a poobchodnej transparentnosti a obchodovacej povinnosti a najmä na účely určenia týchto faktorov:
 - a) či pre kapitálové finančné nástroje, finančné nástroje podobné akciám a nekapitálové finančné nástroje existuje likvidný trh;
 - b) prahových hodnôt pre výnimky z predobchodnej transparentnosti pre kapitálové finančné nástroje, finančné nástroje podobné akciám a nekapitálové finančné nástroje;

⁽¹⁾ Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2004/39/ES z 21. apríla 2004 o trhoch s finančnými nástrojmi, o zmene a doplnení smerníc Rady 85/611/EHS a 93/6/EHS a smernice Európskeho parlamentu a Rady 2000/12/ES a o zrušení smernice Rady 93/22/EHS (Ú. v. EÚ L 145, 30.4.2004, s. 1).

⁽²⁾ Nariadenie Komisie (ES) č. 1287/2006 z 10. augusta 2006, ktorým sa vykonáva smernica Európskeho parlamentu a Rady 2004/39/ES, pokiaľ ide o povinnosti pri vedení záznamov pre investičné spoločnosti, oznamovanie transakcií, priehľadnosť trhu, prijatie finančných nástrojov na obchodovanie a vymedzené pojmy na účely tejto smernice (Ú. v. EÚ L 241, 2.9.2006, s. 1).

⁽³⁾ Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

- c) prahových hodnôt pre odklady poobchodnej transparentnosti pre kapitálové finančné nástroje, finančné nástroje podobné akciám a nekapitálové finančné nástroje;
- d) kedy likvidita určitej triedy finančných nástrojov klesne pod stanovenú prahovú hodnotu;
- e) či je investičná spoločnosť systematickým internalizátorom;
- f) štandardného trhového objemu platného pre systematických internalizátorov pracujúcich s kapitálovými nástrojmi a nástrojmi podobnými akciám a objemu špecifického pre daný nástroj, platného pre systematických internalizátorov pracujúcich s nekapitálovými nástrojmi;
- g) pre kapitálové finančné nástroje a finančné nástroje podobné akciám – celkového objemu obchodovania počas predchádzajúcich 12 mesiacov a percentuálneho podielu obchodov, pri ktorých sa využívajú výnimky z dohodnutého obchodu aj z referenčnej ceny, a to za celú Úniu i za jednotlivé obchodné miesta počas predchádzajúcich 12 mesiacov;
- h) či sú deriváty dostatočne likvidné na účely splnenia obchodovacej povinnosti pre deriváty.

Článok 2

Obsah žiadostí o poskytnutie údajov a informácií, ktoré sa majú oznamovať

1. Na účely vykonávania výpočtov, ktoré sa uskutočňujú vo vopred stanovených termínoch alebo vo vopred určených frekvenciách, obchodné miesta, APA a CTP poskytnú svojim príslušným orgánom všetky údaje potrebné na výpočty stanovené v týchto nariadeniach:
 - a) delegované nariadenie (EÚ) 2017/587;
 - b) delegované nariadenie (EÚ) 2017/583;
 - c) delegované nariadenie (EÚ) 2017/567;
 - d) delegované nariadenie (EÚ) 2017/565.
2. Príslušné orgány môžu v prípade potreby od obchodných miest, APA a CTP požadovať ďalšie informácie na účely monitorovania a úpravy prahových hodnôt a parametrov uvedených v článku 1 písm. a) až f) a písm. h).
3. Príslušné orgány môžu v súvislosti s nekapitálovými finančnými nástrojmi požadovať všetky údaje, ktoré musí orgán ESMA zohľadniť v súlade s delegovaným nariadením (EÚ) 2016/2020, a to vrátane týchto údajov:
 - a) priemernej frekvencie obchodov;
 - b) priemerného objemu a distribúcie obchodov;
 - c) počtu a druhu účastníkov trhu;
 - d) priemernej veľkosti rozpätí.

Článok 3

Frekvencia žiadostí o poskytnutie údajov a lehoty na odpoveď obchodných miest, APA a CTP

1. Obchodné miesta, APA a CTP predkladajú údaje uvedené v článku 2 ods. 1 každodenne.
2. Obchodné miesta, APA a CTP predkladajú údaje v odpovedi na *ad hoc* žiadosť uvedenú v článku 2 ods. 2 do štyroch týždňov od prijatia tejto žiadosti, pokiaľ si výnimočné okolnosti nevyžadujú odpoveď v kratšej lehote, ktorá je uvedená v žiadosti.
3. Odchyľne od odsekov 1 a 2 obchodné miesta a CTP predkladajú údaje, ktoré sa majú použiť na účely mechanizmu objemového prahu, v súlade s odsekmi 6 až 9 článku 6.

Článok 4

Formát žiadostí o poskytnutie údajov

Obchodné miesta, APA a CTP predkladajú údaje uvedené v článku 2 v spoločnom formáte XML, a to pokiaľ možno v súlade so všetkými ostatnými špecifikáciami z hľadiska obsahu a formátu stanovenými na uľahčenie efektívneho a automatizovaného procesu poskytovania údajov a ich konsolidácie s podobnými údajmi z iných zdrojov.

Článok 5

Druh údajov, ktoré sa musia uchovávať, a minimálne obdobie, počas ktorého obchodné miesta, APA a CTP uchovávajú údaje

1. Obchodné miesta, APA a CTP uchovávajú všetky údaje potrebné na výpočet, monitorovanie alebo úpravu prahových hodnôt a parametrov stanovených v článku 2 bez ohľadu na to, či boli tieto informácie zverejnené, alebo nie.
2. Obchodné miesta, APA a CTP uchovávajú údaje uvedené v odseku 1 najmenej tri roky.

Článok 6

Požiadavky pre obchodné miesta a CTP týkajúce sa oznamovania na účely mechanizmu objemového prahu

1. Pre každý finančný nástroj, na ktorý sa vzťahujú požiadavky na transparentnosť v článku 3 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, obchodné miesta predložia príslušnému orgánu tieto údaje:
 - a) celkový objem obchodovania s finančným nástrojom vykonaný na danom obchodnom mieste;
 - b) celkové objemy obchodovania s finančným nástrojom vykonané na danom obchodnom mieste s využitím výnimiek podľa článku 4 ods. 1 písm. a), resp. článku 4 ods. 1 písm. b) bodu i) nariadenia (EÚ) č. 600/2014 s celkovými objemami oznamovanými oddelene pre každú výnimku.
2. Pre každý finančný nástroj, na ktorý sa vzťahujú požiadavky na transparentnosť v článku 3 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, a na požiadanie príslušného orgánu CTP predložia príslušnému orgánu tieto údaje:
 - a) celkové objemy obchodovania s finančným nástrojom vykonané na všetkých obchodných miestach v Únii s celkovými objemami oznamovanými oddelene pre každé obchodné miesto;
 - b) celkové objemy obchodovania vykonané na všetkých obchodných miestach v Únii s využitím výnimiek podľa článku 4 ods. 1 písm. a), resp. článku 4 ods. 1 písm. b) bodu i) nariadenia (EÚ) č. 600/2014 s celkovými objemami oznamovanými oddelene pre každú výnimku a každé obchodné miesto.
3. Obchodné miesta a CTP oznamujú údaje stanovené v odsekoch 1 a 2 príslušnému orgánu vo formátoch uvedených v prílohe. Zabezpečia najmä, aby identifikátory obchodného miesta, ktoré poskytujú, boli dostatočne podrobné na to, aby príslušnému orgánu a orgánu ESMA umožnili zistiť objemy obchodovania vykonané s využitím výnimky z referenčnej ceny a – v prípade likvidných finančných nástrojov – s využitím výnimky z dohodnutého obchodu pre každé obchodné miesto, a aby umožnili výpočet pomeru stanoveného v článku 5 ods. 1 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
4. Na účely výpočtu objemov uvedených v odsekoch 1 a 2:
 - a) objem jednotlivej transakcie sa určí vynásobením ceny finančného nástroja počtom obchodovaných jednotiek;
 - b) celkový objem obchodovania s jednotlivými finančnými nástrojmi uvedenými v odseku 1 písm. a) a odseku 2 písm. a) sa určí spočítaním objemu všetkých individuálnych transakcií a transakcií započítaných z jednej strany pre tento finančný nástroj;
 - c) obchodované objemy stanovené v odseku 1 písm. b) a odseku 2 písm. b) sa určia spočítaním objemu všetkých individuálnych transakcií a transakcií započítaných z jednej strany pre tento finančný nástroj, oznámených ako „referenčná cena“, a „dohodnuté transakcie s likvidnými finančnými nástrojmi“ podľa tabuľky 4 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2017/587.

5. Obchodné miesta a CTP spočítavajú len transakcie vykonané v rovnakej mene a samostatne oznamujú každý súhrnný objem v mene použitej v transakciách.
6. Obchodné miesta predkladajú údaje uvedené v odsekoch 1 až 5 príslušnému orgánu v prvý a šesťnásty deň každého kalendárneho mesiaca do 13.00 hod. SEČ. Ak prvý alebo šesťnásty deň kalendárneho mesiaca nie je pracovným dňom obchodného miesta, obchodné miesto oznámi údaje príslušnému orgánu do 13.00 hod. SEČ nasledujúceho pracovného dňa.
7. Obchodné miesta predkladajú príslušnému orgánu celkové objemy obchodovania stanovené v súlade s odsekmi 1 až 5 v týchto lehotách:
- pre správy predkladané v šesťnásty deň každého kalendárneho mesiaca je vykonávacie obdobie od prvého do pätnásteho dňa toho istého kalendárneho mesiaca;
 - pre správy predkladané v prvý deň každého kalendárneho mesiaca je vykonávacie obdobie od šesťnásteho do posledného dňa predchádzajúceho kalendárneho mesiaca.
8. Odchylné od odsekov 6 a 7 obchodné miesta predkladajú prvú správu za daný finančný nástroj v deň nadobudnutia účinnosti smernice 2014/65/EÚ a nariadenia (EÚ) č. 600/2014 do 13.00 hod. SEČ, pričom do správy zahrnú obchodované objemy uvedené v odseku 1 za predchádzajúci kalendárny rok. Na tieto účely obchodné miesta oddelene za každý kalendárny mesiac oznamujú tieto údaje:
- obchodované objemy počas obdobia od prvého do pätnásteho dňa každého kalendárneho mesiaca;
 - obchodované objemy počas obdobia od šesťnásteho do posledného dňa každého kalendárneho mesiaca.
9. Obchodné miesta a CTP odpovedajú na každú ad hoc žiadosť príslušných orgánov o objem obchodovania v súvislosti s výpočtom, ktorý sa má vykonať na účely monitorovania využívania výnimiek z referenčnej ceny alebo z dohodnutého obchodu, do konca pracovného času v nasledujúci pracovný deň po podaní žiadosti.

Článok 7

Požiadavky pre príslušné orgány týkajúce sa oznamovania orgánu ESMA na účely mechanizmu objemového prahu a obchodovacej povinnosti pre deriváty

- Príslušné orgány poskytujú orgánu ESMA údaje získané od obchodného miesta alebo CTP v súlade s článkom 6 do 13.00 hod. SEČ v nasledujúci pracovný deň po ich prijatí.
- Príslušné orgány poskytujú orgánu ESMA údaje získané od obchodného miesta, APA alebo CTP na účely určenia, či sú deriváty dostatočne likvidné, ako je uvedené v článku 1 písm. h), bezodkladne a najneskôr do troch pracovných dní odo dňa prijatia príslušných údajov.

Článok 8

Požiadavky pre orgán ESMA týkajúce sa oznamovania na účely mechanizmu objemového prahu

- Orgán ESMA zverejní údaje o celkovom objeme obchodovania pre každý finančný nástroj počas predchádzajúcich 12 mesiacov a o percentuálnom podiele obchodov, pri ktorých sa využívajú výnimky z dohodnutého obchodu a z referenčnej ceny, a to za celú Úniu i za jednotlivé obchodné miesta počas predchádzajúcich 12 mesiacov v súlade s odsekmi 4, 5 a 6 článku 5 nariadenia (EÚ) č. 600/2014 najneskôr do 22.00 hod. SEČ v piaty pracovný deň po uplynutí oznamovacích období uvedených v článku 6 ods. 6 tohto nariadenia.
- Zverejnenie uvedené v odseku 1 sa poskytuje bezplatne, vo formáte čitateľnej strojom a človekom, ako je stanovené v článku 14 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2017/571⁽¹⁾ a v článku 13 ods. 4 a 5 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/567.

⁽¹⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/571 z 2. júna 2016, ktorým sa dopĺňa smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa udeľovania povolenia, organizačných požiadaviek a uverejňovania transakcií pre poskytovateľov služieb vykazovania údajov (pozri stranu 126 tohto úradného vestníka).

3. Ak sa s finančným nástrojom obchoduje vo viacerých menách v rámci Únie, orgán ESMA prevedie všetky objemy na eurá s použitím priemerných výmenných kurzov vypočítaných na základe denných referenčných výmenných devízových kurzov eura uverejňovaných Európskou centrálnou bankou na jej webovom sídle počas predchádzajúcich 12 mesiacov. Tieto prevedené objemy sa použijú na výpočet a zverejnenie celkového objemu obchodovania a percentuálneho podielu obchodov, pri ktorých sa využívajú výnimky z dohodnutého obchodu a z referenčnej ceny, a to za celú Úniu i za jednotlivé obchodné miesta, ako je uvedené v odseku 1.

Článok 9

Nadobudnutie účinnosti a uplatňovanie

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Uplatňuje sa od 3. januára 2018.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 13. júna 2016

Za Komisiu
predseda
Jean-Claude JUNCKER

PRÍLOHA

Tabuľka 1

Tabuľka symbolov pre tabuľku 2

SYMBOL	TYP ÚDAJOV	VYMEDZENIE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znakov	Voľné textové pole.
{DECIMAL-n/m}	Desatinné číslo zložené spolu až z n číslic, z ktorých až m číslic môžu byť zlomkové číslice.	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty. — oddeľovač desatinných miest je „.“ (bodka), — pred číslom môže byť pripojený znak „-“ (mínus) na označenie záporných čísel. Hodnoty musia byť v prípade potreby zaokrúhlené, nie však skrátené.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	3-miestny alfabetycký kód meny podľa menových kódov ISO 4217
{DATEFORMAT}	formát dátumu podľa ISO 8601	Dátumy sa uvádzajú v tomto formáte: RRRR-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumerických znakov	kód ISIN podľa ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	identifikátor trhu podľa vymedzenia v ISO 10383

Tabuľka 2

Formáty správy na účely mechanizmu objemového prahu

Názov dátového poľa	Formát
Obdobie vykazovania	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} kde prvý dátum je začiatok obdobia vykazovania a druhý dátum je koniec obdobia vykazovania.
Identifikácia oznamujúceho subjektu	Ak je oznamujúci subjekt obchodným miestom: {MIC} (kód MIC segmentu, alebo podľa potreby prevádzkový kód MIC) alebo {ALPHANUM-50} Ak je oznamujúci subjekt protistranou:
Identifikátor obchodného miesta	{MIC} (kód MIC segmentu, ak je k dispozícii, inak prevádzkový kód MIC).
Identifikačný kód nástroja	{ISIN}
Mena transakcií	{CURRENCYCODE_3}
Celkový objem obchodov (podľa mien)	{DECIMAL-18/5}

Názov dátového poľa	Formát
Celkový objem obchodov, na ktoré sa vzťahuje výnimka z referenčnej ceny v zmysle článku 4 ods. 1 písm. a) nariadenia MiFIR (podľa mien)	{DECIMAL-18/5}
Celkový objem obchodov, na ktoré sa vzťahuje výnimka z dohodnutého obchodu v zmysle článku 4 ods. 1 písm. b) bodu i) nariadenia MiFIR (podľa mien)	{DECIMAL-18/5}