

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/577**av den 13 juni 2016****om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 om marknader för finansiella instrument avseende tekniska standarder för tillsyn för volymtaksmechanismen och tillhandahållande av information för säkerställande av transparens samt andra beräkningar****(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artiklarna 5.9 och 22.4, och

av följande skäl:

- (1) Enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 krävs att behöriga myndigheter och Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) utför ett stort antal beräkningar för att kalibrera tillämpningen av informationssystemet före och efter handel och handelsskyldigheten för derivat samt för att fastställa om ett värdepappersföretag är en systematisk internhandlare.
- (2) För att utföra de nödvändiga beräkningarna behöver både behöriga myndigheter och Esma tillgång till tillförlitliga uppgifter av hög kvalitet för varje tillgångsklass som förordning (EU) nr 600/2014 gäller för. Det är därför nödvändigt att förbättra både tillgången till och kvaliteten på uppgifter som är tillgängliga för behöriga myndigheter och Esma i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU ⁽²⁾ och förordning (EU) nr 600/2014, så att klassificeringen av finansiella instrument, däribland trösklar för transparens före och efter handel och, vid behov, omkalibreringar av dessa trösklar, kan beräknas på ett mer välinformerat sätt, när systemet har varit i funktion en viss tid.
- (3) Bestämmelser bör fastslås som i allmänna termer specificerar gemensamma faktorer med avseende på innehåll och format på uppgifter som lämnas in av handelsplatser, godkända publiceringsarrangemang (APA) och tillhandahållare av konsoliderad handelsinformation (CTP) för säkerställande av transparens samt andra beräkningar. Bestämmelserna bör läsas tillsammans med kommissionens delegerade förordningar (EU) 2017/587 ⁽³⁾, (EU) 2017/583 ⁽⁴⁾, (EU) 2017/567 ⁽⁵⁾, (EU) 2017/565 ⁽⁶⁾ och (EU) 2016/2020 ⁽⁷⁾ som beskriver vilka metoder och uppgifter som krävs för att utföra de relevanta beräkningarna och specificerar innehåll och

⁽¹⁾ EUT L 173, 12.6.2014, s. 84.

⁽²⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

⁽³⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/587 av den 14 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 om marknader för finansiella instrument avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller krav på transparens för handelsplatser och värdepappersföretag för aktier, depåbevis, börshandlade fonder, certifikat och andra liknande finansiella instrument och krav på att utföra transaktioner för vissa aktier på en handelsplats eller genom en systematisk internhandlare (se sidan 387 i detta nummer av EUT).

⁽⁴⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/583 av den 14 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 om marknader för finansiella instrument avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller krav på transparens för handelsplatser och värdepappersföretag för obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter och derivat (se sidan 229 i detta nummer av EUT).

⁽⁵⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/567 av den 18 maj 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende definitioner, transparens, portföljkompression och tillsynsätgärder beträffande produktgrupper och positioner (se sidan 90 i detta nummer av EUT).

⁽⁶⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/565 av den 25 april 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU vad gäller organisatoriska krav och villkor för verksamheten i värdepappersföretag, och definitioner för tillämpning av det direktivet (se sidan 1 i detta nummer av EUT).

⁽⁷⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2016/2020 av den 26 maj 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 om marknader för finansiella instrument avseende tekniska standarder för tillsyn för kriterier för att bestämma huruvida derivat som är föremål för clearingkravet även ska vara föremål för handelsskyldigheten (EUT L 313, 19.11.2016, s. 2).

omfattning på de uppgifter som krävs för att utföra transparensberäkningarna. Därför bör innehåll, format och kvalitet på uppgifter som överlämnas avseende handelsplatser, APA och CTP överensstämja med de tillämpliga metoder som föreskrivs i de relevanta genomförandeakterna till Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU och förordning (EU) nr 600/2014 när sådana beräkningar utförs.

- (4) Med undantag för uppgifter som eventuellt begärs ad hoc och beräkningar som ska utföras för volymtaksmekanismen bör handelsplatser, APA och CTP rapportera dagligen. Med tanke på de många typer av finansiella instrument som omfattas och den stora mängden uppgifter som ska behandlas hjälper en daglig inlämning de behöriga myndigheterna att behandla filer av hanterbar storlek mer korrekt, och garanterar att uppgifterna lämnas in på ett effektivt sätt och i rätt tid, och att de kan kvalitetskontrolleras och behandlas. Att samla in uppgifter dagligen förenklar också kravet på uppgiftsinlämning från handelsplatser, APA och CTP genom att de slipper beräkna antalet handelsdagar i de fall kvantitativt likviditetskriterium gäller, och aggregera uppgifter för samma finansiella instrument med olika förfalloperioder i de fall tiden fram till förfalldag ska beaktas. Att centralisera beräkningarna garanterar också en enhetlig tillämpning av kriterierna på alla finansiella instrument och handelsplatser.
- (5) Handelsplatser bör lagra uppgifter som är fullständiga och som möjliggör att behöriga myndigheter och Esma kan utföra korrekta beräkningar. Den information som behövs finns vanligen i rapporterna efter handel, men i vissa fall kan det krävas mer information för beräkningarna än den som finns i dessa rapporter. Det omfattar till exempel information om transaktioner som genomförts utifrån order som omfattats av undantaget för omfattande order. Denna information bör inte ingå i handelsrapporter, eftersom den skulle kunna utsätta sådana transaktioner för negativa marknadseffekter. Eftersom informationen dock kan behövas för att behöriga myndigheter ska kunna utföra korrekta beräkningar bör den förvaras på lämpligt sätt av handelsplatser, APA och CTP, och meddelas till behöriga myndigheter och Esma vid behov. Handelsplatser bör se till att de sprider den information som ska ges till behöriga myndigheter och Esma på ett lämpligt sätt. Transaktioner som utförts utifrån omfattande order bör identifieras på lämpligt sätt i deras rapport till CTP.
- (6) Uppgifter bör samlas in från flera olika källor, eftersom en enda källa kanske inte alltid innehar fullständiga uppgifter för en tillgångsklass eller ens ett visst instrument. För att ge behöriga myndigheter och Esma tillgång till och samordna uppgifter av hög kvalitet från olika källor bör handelsplatser, APA och CTP om möjligt använda fördefinierade specifikationer för innehåll och format för att underlätta datainsamlingen och sänka kostnaderna.
- (7) Med tanke på hur känsliga de nödvändiga beräkningarna är och de potentiella kommersiella följderna för handelsplatser, emittenter och andra marknadsaktörer av att offentliggöra felaktig information som, i samband med volymtaksmekanismen, skulle kunna leda till indragning av undantag för en enskild handelsplats eller i hela unionen för ett visst finansiellt instrument, är det centralt att precisera formatet för de uppgifter som ska lämnas in till de behöriga myndigheterna och Esma, för att inrätta effektiva kommunikationskanaler med handelsplatser och CTP, och säkra att de nödvändiga uppgifterna offentliggörs i rätt tid och är korrekta.
- (8) Enligt förordning (EU) nr 600/2014 krävs att Esma för finansiella instrument som omfattas av volymtaksmekanismen offentliggör mått på den totala handelsvolymen under de senaste 12 månaderna och procentsatser handel under både undantag vid manuella avslut och referensprisundantag i hela unionen och för varje handelsplats de senaste 12 månaderna. För finansiella instrument som handlats i mer än en valuta är det nödvändigt att konvertera de volymer som omsatts i främmande valutor till en gemensam valuta, för att sammanställa volymerna och utföra de beräkningar som krävs. Därför bör det vid behov anges vilka metoder och växelkurser som ska användas för att konvertera handelsvolymerna.
- (9) För volymtaksmekanismen bör det krävas att handelsplatser rapporterar volymer på handel som utförts under tillämpning av referensprisundantag och, för likvida instrument, undantag vid manuella avslut. Eftersom undantagen gäller för order och inte för transaktioner är det viktigt att förtydliga att de volymer som rapporteras ska omfatta alla transaktioner flaggade som "RFPT" eller "NLIQ" för offentliggörande av transaktioner efter handel enligt vad som specificeras i delegerade förordning (EU) 2017/587. Om en transaktion har utförts utifrån två order som omfattas av undantaget för omfattande order bör transaktionen inte räknas mot de volymer som beräknats under tillämpning av referensprisundantag och undantag vid manuella avslut.
- (10) För volymtaksmekanismen bör handelsplatser och CTP garantera att handelsplatsen där transaktionen utfördes identifieras på en tillräcklig storleksmässig uppdelningsnivå för att Esma ska kunna utföra alla beräkningar som

avses i förordning (EU) nr 600/2014. I synnerhet bör handelsplatsens identifieringskod vara unik för handelsplatsen och inte delas med någon annan handelsplats som drivs av samma marknadsoperatör. Handelsplatsers identifieringskod bör möjliggöra för Esma att på ett entydigt sätt skilja mellan alla handelsplatser för vilka marknadsoperatören har fått en särskild auktorisation enligt direktiv 2014/65/EU.

- (11) För volymtaksmechanismen är det nödvändigt att kräva att handelsplatser lämnar in en första rapport samma dag som direktiv 2014/65/EU och förordning (EU) nr 600/2014 träder i kraft, med handelsvolymerna som omfattas av referensprisundantaget och, för likvida finansiella instrument, handelsvolymerna som omfattas av undantaget vid manuella avslut, för föregående kalenderår. För att säkra en proportionerlig tillämpning av kravet bör handelsplatser basera sin rapport på justerade volymer av handel som utförts under motsvarande undantag enligt Europaparlamentets och rådets direktiv 2004/39/EG ⁽¹⁾ och kommissionens förordning (EG) nr 1287/2006 ⁽²⁾.
- (12) För att ge behöriga myndigheter och Esma tillgång till korrekta uppgifter bör handelsplatser, APA och CTP se till att deras rapporter endast omfattar en sida av transaktionen (single-counted).
- (13) Bestämmelserna i denna förordning hör nära ihop, eftersom de handlar om att specificera innehåll, frekvens, format på begäran av uppgifter, metod för behandling av uppgifterna och andra specifikationer avseende offentliggörande av information för säkerställande av transparens enligt vad som avses i förordning (EU) nr 600/2014. För att säkerställa enhetlighet mellan bestämmelserna, som kommer att träda i kraft samtidigt, och göra dem överskådliga för berörda parter, särskilt de som omfattas av kraven, är det önskvärt att samla dem i en enda förordning.
- (14) Av konsekvensskäl och för att garantera att de finansiella marknaderna fungerar smidigt är det nödvändigt att bestämmelserna i denna förordning och bestämmelserna i förordning (EU) nr 600/2014 gäller från samma datum.
- (15) Denna förordning grundar sig på de förslag till tekniska standarder för tillsyn som Esma har lagt fram för kommissionen.
- (16) Esma har genomfört öppna offentliga samråd om det förslag till tekniska standarder för tillsyn som denna förordning baseras på. Esma har även analyserat möjliga relaterade kostnader och fördelar samt begärt in ett yttrande av den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 ⁽³⁾.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Syfte och tillämpningsområde

1. Denna förordning fastställer detaljerna för begäran av uppgifter som ska lämnas in av behöriga myndigheter och detaljerna för de svar som ska lämnas in av handelsplatser, godkända publiceringsarrangemang (APA) och tillhandahållare av konsoliderad handelsinformation (CTP), för beräkning och justering av system för transparens före och efter handel, och handelsskyldighet, i synnerhet för att fastställa följande faktorer:

- a) Huruvida aktierelaterade, aktieliknande och icke-aktierelaterade finansiella instrument har en likvid marknad.
- b) Trösklarna för transparensundantag före handel för aktierelaterade, aktieliknande och icke-aktierelaterade finansiella instrument.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2004/39/EG av den 21 april 2004 om marknader för finansiella instrument och om ändring av rådets direktiv 85/611/EEG och 93/6/EEG och Europaparlamentets och rådets direktiv 2000/12/EG samt upphävande av rådets direktiv 93/22/EEG (EUT L 145, 30.4.2004, s. 1).

⁽²⁾ Kommissionens förordning (EG) nr 1287/2006 av den 10 augusti 2006 om genomförande av Europaparlamentets och rådets direktiv 2004/39/EG vad gäller dokumenteringsskyldigheter för värdepappersföretag, transaktionsrapportering, överblickbarhet på marknaden, upptagande av finansiella instrument till handel samt definitioner för tillämpning av det direktivet (EUT L 241, 2.9.2006, s. 1).

⁽³⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

- c) Trösklarna för uppskjutande av transparens efter handel för aktierelaterade, aktieliknande och icke-aktierelaterade finansiella instrument.
- d) När likviditeten för en klass finansiella instrument faller under en viss tröskel.
- e) Om ett värdepappersföretag är en systematisk internhandlare.
- f) Standardiserad marknadsstorlek på systematiska internhandlare av aktierelaterade och aktieliknande instrument, och storleken på det instrument som tillämpas på systematiska internhandlare av icke-aktierelaterade instrument.
- g) För aktierelaterade och aktieliknande instrument den totala handelsvolymen under de senaste 12 månaderna och procentandel handel under både undantag vid manuella avslut och referensprisundantag i hela unionen och för varje handelsplats de senaste 12 månaderna.
- h) Om derivat är tillräckligt likvida för att omfattas av handelsskyldigheten för derivat.

Artikel 2

Innehåll i begäran av uppgifter och information som ska rapporteras

1. För beräkningar som ska utföras på förbestämda datum eller i förbestämda intervaller ska handelsplatser, APA och CTP förse sina behöriga myndigheter med alla uppgifter som krävs för att utföra de beräkningar som föreskrivs i följande förordningar:
 - a) Delegerade förordning (EU) 2017/587.
 - b) Delegerade förordning (EU) 2017/583.
 - c) Delegerade förordning (EU) 2017/567.
 - d) Delegerade förordning (EU) 2017/565.
2. Behöriga myndigheter får vid behov begära ytterligare information för övervakning och justering av de trösklar och parametrar som avses i artikel 1 a–f och h från handelsplatser, APA och CTP.
3. Behöriga myndigheter får begära alla uppgifter som Esma måste beakta i enlighet med delegerade förordning (EU) 2016/2020 för icke-aktierelaterade finansiella instrument, däribland uppgifter om följande:
 - a) Den genomsnittliga transaktionsfrekvensen.
 - b) Den genomsnittliga storleken och fördelningen för transaktioner.
 - c) Antalet och typ av marknadsdeltagare.
 - d) Den genomsnittliga storleken på spreaden.

Artikel 3

Frekvensen för begäran av uppgifter samt svarstider för handelsplatser, APA och CTP

1. Handelsplatser, APA och CTP ska lämna in de uppgifter som avses i artikel 2.1 dagligen.
2. Handelsplatser, APA och CTP ska lämna in uppgifter som svar på en ad hoc-begäran enligt artikel 2.2 inom fyra veckor efter det att de mottagit begäran, om inte exceptionella omständigheter gör att det krävs svar snabbare än vad som anges i begäran.
3. Genom undantag från punkterna 1 och 2 ska CTP lämna in uppgifter som ska användas för volymtaksmechanismen enligt vad som föreskrivs i artikel 6.6–6.9.

*Artikel 4***Format på begäran av uppgifter**

Handelsplatser, APA och CTP ska lämna in de uppgifter som avses i artikel 2 i vanligt XML-format och, om tillgängligt, i överensstämmelse med eventuella specifikationer för innehåll och format avsedda att underlätta en effektiv och automatiserad hantering av uppgifter samt konsolidering med liknande uppgifter från andra källor.

*Artikel 5***Typ av uppgifter som måste lagras och den minimiperiod under vilken handelsplatser, APA och CTP måste lagra uppgifter**

1. Handelsplatser, APA och CTP måste lagra alla uppgifter som krävs för att beräkna, övervaka eller justera de trösklar och parametrar som avses i artikel 2, oavsett om informationen är offentlig eller inte.
2. Handelsplatser, APA och CTP måste lagra alla uppgifter som avses i punkt 1 under minst tre år.

*Artikel 6***Rapporteringskrav för handelsplatser och CTP avseende volymtaksmechanismen**

1. För varje finansiellt instrument som omfattas av transparenskraven i artikel 3 i förordning (EU) nr 600/2014 ska handelsplatser lämna in följande uppgifter till den behöriga myndigheten:
 - a) Den totala handelsvolymen för det finansiella instrumentet på handelsplatsen.
 - b) Den totala handelsvolymen för det finansiella instrumentet på handelsplatsen som omfattas av undantagen enligt artikel 4.1 a respektive 4.1 b i i förordning (EU) nr 600/2014, med totalvolym rapporterade separat för varje undantag.
2. För varje finansiellt instrument som omfattas av transparenskraven i artikel 3 i förordning (EU) nr 600/2014 och på begäran från den behöriga myndigheten ska CTP lämna in följande uppgifter till den behöriga myndigheten:
 - a) Den totala handelsvolymen för det finansiella instrumentet på samtliga handelsplatser i unionen, med totalvolym rapporterade separat för varje handelsplats.
 - b) Den totala handelsvolymen på alla handelsplatser i unionen som omfattas av undantagen enligt artikel 4.1 a respektive 4.1 b i i förordning (EU) nr 600/2014, med totalvolym rapporterade separat för varje undantag och för varje handelsplats.
3. Handelsplatser och CTP ska rapportera de uppgifter som avses i punkterna 1 och 2 till den behöriga myndigheten i de format som finns i bilagan. De ska i synnerhet se till att handelsplatsernas identifieringskoder har en tillräcklig storleksmässig uppdelning för att den behöriga myndigheten och Esma ska kunna identifiera de volymer som har handlats med tillämpning av referensprisundantag och, för likvida finansiella instrument, med tillämpning av undantag vid manuella avslut för varje handelsplats och möjliggöra beräkning av den kvot som avses i artikel 5.1 a i förordning (EU) nr 600/2014.
4. För att beräkna de volymer som avses i punkterna 1 och 2 gäller följande:
 - a) Volymen på en enskild transaktion fastställs genom att multiplicera det finansiella instrumentets pris med antalet handlade enheter.
 - b) Den totala handelsvolymen för varje finansiellt instrument som avses i punkterna 1 a och 2 a fastställs genom att aggregera volymen för alla enskilda transaktioner och transaktioner där endast en sida räknas (single-counted) i det aktuella finansiella instrumentet.
 - c) De handelsvolymerna som avses i punkterna 1 b och 2 b fastställs genom att aggregera volymerna för enskilda transaktioner och transaktioner där endast en sida räknas (single-counted) i det finansiella instrumentet som rapporteras under "referenspris" och "manuella avslut i likvida instrument" i enlighet med tabell 4 i bilaga I till delegerade förordning (EU) 2017/587.

5. Handelsplatser och CTP ska endast aggregera transaktioner som utförts i samma valuta och ska rapportera separat varje aggregerad volym i den valuta som använts för transaktionerna.
6. Handelsplatser ska lämna in de uppgifter som avses i punkterna 1–5 till den behöriga myndigheten på den första och sextonde dagen i varje kalendermånad senast kl. 13:00 CET. Om den första eller sextonde dagen i varje kalendermånad är en helgdag för handelsplatsen ska handelsplatsen rapportera uppgifterna till den behöriga myndigheten senast kl. 13:00 CET nästa arbetsdag.
7. Handelsplatser ska till den behöriga myndigheten lämna in totala handelsvolymerna fastställda i enlighet med punkterna 1–5 enligt följande tidsperioder:
- För rapporter som ska lämnas in den sextonde dagen i varje kalendermånad löper genomförandeperioden från första dagen till femtonde dagen i samma kalendermånad.
 - För rapporter som ska lämnas in den första dagen i varje kalendermånad löper genomförandeperioden från sextonde dagen till sista dagen i föregående kalendermånad.
8. Genom undantag från punkterna 6 och 7 ska handelsplatser lämna in den första rapporten per finansiellt instrument senast kl. 13:00 CET samma dag som direktiv 2014/65/EU och förordning (EU) nr 600/2014 träder i kraft, med de handelsvolymerna som avses i punkt 1 för föregående kalenderår. Handelsplatser ska därför för varje kalendermånad rapportera följande separat:
- Handelsvolymerna under perioden från första dagen till femtonde dagen i varje kalendermånad.
 - Handelsvolymerna under perioden från sextonde dagen till sista dagen i varje kalendermånad.
9. Handelsplatser och CTP ska besvara en ad hoc-begäran från behöriga myndigheter om handelsvolymerna i samband med den beräkning som ska göras för att övervaka referensprisundantag och undantag vid manuella avslut, senast vid slutet av den arbetsdag som följer efter begäran.

Artikel 7

Rapporteringskrav för behöriga myndigheter till Esma avseende volymtaksmechanismen och handelsskyldigheten för derivat

- Behöriga myndigheter ska förse Esma med uppgifter som mottagits från en handelsplats eller CTP i enlighet med artikel 6 senast kl. 13:00 CET arbetsdagen efter att de mottog uppgifterna.
- Behöriga myndigheter ska förse Esma med uppgifter som mottagits från en handelsplats, APA eller CTP för att fastställa huruvida derivat är tillräckligt likvida enligt vad som avses i artikel 1 h, utan omtiverat dröjsmål och senast tre arbetsdagar efter att de mottog de relevanta uppgifterna.

Artikel 8

Rapporteringskrav för Esma avseende volymtaksmechanismen

- Esma ska offentliggöra mätningar av den totala handelsvolymerna per finansiellt instrument under de senaste 12 månaderna och de procentandelar handel som tillämpade både undantag vid manuella avslut och referensprisundantag i hela unionen och per handelsplats de senaste 12 månaderna, i enlighet med punkterna 4, 5 och 6 i artikel 5 i förordning (EU) nr 600/2014, senast kl. 22:00 CET den femte arbetsdagen efter rapporteringsperiodernas slut, enligt artikel 6.6 i denna förordning.
- Offentliggörandet enligt punkt 1 ska vara kostnadsfritt och i ett format som är läsbart för maskin och människa, enligt vad som avses i artikel 14 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/571⁽¹⁾ och i artiklarna 13.4 och 13.5 i delegerade förordning (EU) 2017/567.

⁽¹⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/571 av den 2 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU avseende tekniska tillsynsstandarder när det gäller auktorisation, organisatoriska krav och publicering av transaktioner för leverantörer av datarapporterings tjänster (se sidan 126 i detta nummer av EUT).

3. Om ett finansiellt instrument har handlats i mer än en valuta i unionen ska Esmä konvertera alla volymer till euro med användning av genomsnittliga valutakurser, som beräknas utifrån den dagliga referensväxelkurs för euron som Europeiska centralbanken har publicerat på sin webbsida de senaste 12 månaderna. De konverterade volymerna ska användas för beräkning och offentliggörande av den totala handelsvolymen och de procentandelar handel som tillämpade både undantag vid manuella avslut och referensprisundantag i hela unionen och per handelsplats, enligt vad som avses i punkt 1.

Artikel 9

Ikraftträdande och tillämpning

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Den ska tillämpas från och med den 3 januari 2018.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 13 juni 2016.

På kommissionens vägnar
Jean-Claude JUNCKER
Ordförande

BILAGA

Tabell 1

Symboltabell för tabell 2

SYMBOL	TYP AV UPPGIFT	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Upp till n alfanumeriska tecken	Fritextfält.
{DECIMAL-n/m}	Decimaltal på upp till n siffror totalt, av vilka upp till m siffror kan vara bråkdelar	Numeriskt fält för både positiva och negativa värden. — Decimaltecknet är "." (punkt). — Talet kan ha prefixet "-" (minus) för att ange negativa tal. Om tillämpligt ska värden avrundas och trunckeras inte.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum anges enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{MIC}	4 alfanumeriska tecken	Kod för marknadsidentifiering enligt ISO 10383

Tabell 2

Rapporteringsformat för volymtaksmechanismen

Datafält	Värdeformat
Rapporteringsperiod	{DATEFORMAT}/{DATEFORMAT} där första datumet är rapporteringsperiodens början och andra datumet är rapporteringsperiodens slut
Identifiering av den rapporterade enheten	Där den rapporterade enheten är en handelsplats: {MIC} (segment-MIC eller, om lämpligt, operativ MIC) eller {ALPHANUM-50} om den rapporterade enheten är en CTP
Handelsplatsens identifieringskod	{MIC} (segment-MIC eller, om tillgängligt, övrig operativ MIC)
Instrumentets identifieringskod	{ISIN}
Transaktionernas valuta	{CURRENCYCODE_3}
Total handelsvolym (per valuta)	{DECIMAL-18/5}

Datafält	Värdeformat
Total handelsvolym under referensprisundantag enligt definitionen i artikel 4.1 a i MiFIR (per valuta)	{DECIMAL-18/5}
Total handelsvolym under undantag vid manuella avslut enligt definitionen i artikel 4.1 b i i MiFIR (per valuta)	{DECIMAL-18/5}