



Euroopan unionin
neuvosto

Bryssel, 30. tammikuuta 2023
(OR. en)

5836/23
ADD 1

EF 29
ECOFIN 83
DELECT 14

SAATE

Lähetäjä:	Euroopan komission pääsihteeri, allekirjoittajana johtaja Martine DEPREZ
Saapunut:	27. tammikuuta 2023
Vastaanottaja:	Thérèse BLANCHET, Euroopan unionin neuvoston pääsihteeri
Kom:n asiak. nro:	C(2023) 245 final
Asia:	LIITTEET asiakirjaan KOMMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) .../... delegoidussa asetuksessa (EU) 2017/587 säädettyjen teknisten sääntelystandardien muuttamisesta ja oikaisemisesta tiettyjen oman pääoman ehtoisia rahoitusvälineitä koskeviin liiketoimiin sovellettavien avoimuusvaatimusten osalta

Valtuuskunnille toimitetaan oheisena asiakirja C(2023) 245 final.

Liite: C(2023) 245 final

Bryssel 17.1.2023
C(2023) 245 final

ANNEXES 1 to 3

LIITTEET

asiakirjaan

KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) .../...

**delegoidussa asetuksessa (EU) 2017/587 säädettyjen teknisten sääntelystandardien
muuttamisesta ja oikaisemisesta tiettyjen oman pääoman ehtoisia rahoitusvälineitä
koskeviin liiketoimiin sovellettavien avoimuusvaatimusten osalta**

LIITE I

Muutetaan delegoidun asetuksen (EU) 2017/587 liite I seuraavasti:

1) Korvataan taulukko 1 seuraavasti:

”Taulukko 1

Kuvaus kaupankäyntijärjestelmän tyypistä ja tiedoista, jotka on julkistettava 3 artiklan mukaisesti

Rivi	Kaupankäyntijärjestelmän tyyppi	Kaupankäyntijärjestelmän kuvaus	Julkistettavat tiedot
1	Jatkuvaan tarjouskirjahuutokauppaan perustuva kaupankäyntijärjestelmä	Järjestelmä, jossa myyntitoimeksiannot ja ostotoimeksiannot täsmäytetään tarjouskirjan ja kaupankäyntialgoritmin avulla jatkuvasti ja automatisoidusti parhaan saatavilla olevan hinnan perusteella.	Toimeksiantojen ja niiden kullakin hintatasolla edustamien osakkeiden, talletustodistusten, pörssilistattujen rahastojen, todistusten ja muiden samankaltaisten rahoitusvälineiden kokonaislukumäärä ainakin viidellä parhaalla osto- ja myyntihinnan tasolla.
2	Hintanoteerauksiin perustuva kaupankäyntijärjestelmä	Järjestelmä, jossa liiketoimet toteutetaan jatkuvasti osapuolten saatavilla olevien sitovien hintatarjousten perusteella ja joka edellyttää markkinatakaajien ylläpitävän hintatarjouksia, joiden koolla tasapainotetaan jäsenten ja osapuolten tarpeet käydä kauppaa kaupallisessa laajuudessa ja riski, jolle markkinatakaaja altistuu.	Kunkin markkinatakaajan hinnaltaan paras osto- ja myyntitarjous osakkeista, talletustodistuksista, pörssilistatuista rahastoista, todistuksista ja muista samankaltaisista rahoitusvälineistä, joilla käydään kaupankäyntijärjestelmässä kauppaa, sekä kyseisiin tarjouksiin sisältyvät volyymit. Julkistettujen hintatarjousten on oltava sitovia rahoitusvälineiden osto- ja myyntitarjouksia, ja niissä on ilmoitettava, millä hinnalla ja kuinka suurina volyymeina rekisteröidyt markkinatakaajat ovat valmiita ostamaan tai myymään kyseisiä rahoitusvälineitä. Suuntaa-antavat tai yksipuoliset hinnat voidaan kuitenkin sallia poikkeuksellisissa markkinaolosuhteissa rajoitetun ajan.
3	Määräajoin toistuvaan huutokauppaan perustuva kaupankäyntijärjestelmä	Järjestelmä, joka täsmäyttää toimeksiantoja määräajoin toistuvan huutokaupan ja kaupankäyntialgoritmin avulla	Hinta, jolla huutokauppajärjestelmä täyttäisi parhaiten kaupankäyntialgoritminsa

		automatisoidusti.	ehdot osakkeiden, talletustodistusten, pörssilistattujen rahastojen, todistusten ja muiden samankaltaisten rahoitusvälineiden osalta, joilla käydään kauppaa kyseisessä kaupankäyntijärjestelmässä, sekä volyymi, jonka järjestelmän osapuolet voisivat potentiaalisesti toteuttaa kyseiseen hintaan.
4	Tarjouspyyntöjärjestelmä	Järjestelmä, jossa annetaan yksi tai useampia hintatarjouksia vastauksena yhden tai useamman jäsenen tai osapuolen esittämään tarjouspyyntöön. Ainoastaan pyynnön esittävä jäsen tai osapuoli voi toteuttaa hintatarjouksen. Pynnön esittävä jäsen tai osapuoli voi toteuttaa liiketoimen hyväksymällä sille pyynnöstä esitetyn hintatarjouksen tai -tarjoukset.	Kaikkien jäsenten tai osapuolten esittämät hintatarjoukset ja niihin liittyvät volyymit, jotka järjestelmän sääntöjen mukaan johtaisivat hyväksytyinä liiketoimeen. Kaikki hintatarjoukset, jotka on esitetty vastauksena tarjouspyyntöön, voidaan julkistaa samanaikaisesti, mutta ne on julkistettava viimeistään, kun niistä tulee toteuttamiskelpoisia.
5	Hybridikaupankäyntijärjestelmä	Järjestelmä, joka kuuluu vähintään kahteen tämän taulukon riveillä 1–4 mainittuun kaupankäyntijärjestelmän tyyppiin.	Jos on kyse hybridijärjestelmästä, joissa yhdistetään eri kaupankäyntijärjestelmiä samanaikaisesti, kyseisiä hybridijärjestelmiä koskevat vaatimukset vastaavat niitä kauppaa edeltäviä avoimuusvaatimuksia, joita sovelletaan kuhunkin hybridijärjestelmän muodostavaan kaupankäyntijärjestelmään. Jos on kyse hybridijärjestelmästä, joissa yhdistetään vähintään kaksi kaupankäyntijärjestelmää peräkkäin, kyseisiä hybridijärjestelmiä koskevat vaatimukset vastaavat niitä kauppaa edeltäviä avoimuusvaatimuksia, joita sovelletaan kulloinkin tiettyinä ajankohtana käytettävään kaupankäyntijärjestelmään.
6	Muu kaupankäyntijärjestelmä	Minkä tahansa muun tyyppinen kaupankäyntijärjestelmä, joka ei kuulu riveille 1–5.	Riittävät tiedot kaupankäyntijärjestelmässä kaupankäynnin kohteina olevia osakkeita, talletustodistuksia,

			pörssilistattuja rahastoja, todistuksia ja muita samankaltaisia rahoitusvälineitä koskevien toimeksiantojen tai hintatarjousten määrästä sekä kyseisiin rahoitusvälineisiin liittyvästä kaupankäynti-intressistä; erityisesti rahoitusvälineen viisi parasta osto- ja myyntihintatasoa ja/tai kunkin markkinatakaajan rahoitusvälineestä tekemät kaksisuuntaiset hintatarjoukset, jos hinnanmuodostusmekanismin ominaispiirteet antavat siihen mahdollisuuden.
--	--	--	---

”

2) Korvataan taulukot 3 ja 4 seuraavasti:

”Taulukko 3

Luettelo kaupan jälkeiseen avoimuuteen liittyvistä tiedoista

#	Kentän tunniste	Kuvaus ja julkistettavat tiedot	Toteuttamispaikan tai julkistamispaikan tyyppi	Taulukon 2 mukaisesti käytettävä muoto

1	Kaupan päivämäärä ja kellonaika	Päivämäärä ja kellonaika, joina liiketoimi on toteutettu. Kauppapaikassa toteutettujen liiketoimien osalta tarkkuusasteen on oltava delegoidun asetuksen (EU) 2017/574 2 artiklan mukainen. Muualla kuin kauppapaikassa toteutettujen liiketoimien osalta ilmoitetaan päivämäärä ja kellonaika, joina osapuolet sopivat seuraavien kenttien sisällöstä: määrä, hinta, valuutat delegoidun asetuksen (EU) 2017/590 liitteessä I olevan taulukon 2 kenttien 31, 34 ja 44 mukaisesti, instrumentin tunnistekoodi, instrumentin luokitus ja kohde-etuutena olevan rahoitusvälineen koodi, tapauksen mukaan. Muualla kuin kauppapaikassa toteutettujen liiketoimien osalta aika ilmoitetaan vähintään lähimmän sekunnin tarkkuudella. Jos liiketoimi johtuu toimeksiannosta, jonka kyseisen toimeksiannon toteuttava yritys on siirtänyt asiakkaan puolesta kolmannelle osapuolelle, eikä siirto ole täyttänyt delegoidun asetuksen (EU) 2017/590 4 artiklassa säädettyjä edellytyksiä, toimeksiannon siirron päivämäärän ja kellonajan sijasta on ilmoitettava liiketoimen päivämäärä ja kellonaika.	Säännelty markkina (RM) Monenkeskinen kaupankäyntijärjestelmä (MTF) Hyväksytty julkistamisjärjestely (APA) Konsolidoitujen kauppätietojen tarjoaja (CTP)	{DATE_TIME_FOR MAT}
2	Rahoitusvälineen tunnistekoodi	Koodi, jolla rahoitusväline yksilöidään.	RM, MTF, APA, CTP	{ISIN}

3	Hinta	Liiketoimen kauppahinta, lukuun ottamatta mahdollista provisiota ja kertynyttä korkoa. Jos hinta ilmoitetaan rahamääräisenä, se on ilmoitettava päävaluutan määräisenä. Jos hintaa ei ole raportointihetkellä saatavilla mutta asia on vireillä ("PNDG") tai jos hinta ei ole sovellettavissa ("NOAP"), kenttä jätetään tyhjäksi.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/13}, jos hinta ilmaistaan rahallisena arvona oman pääoman ehtojen ja niiden kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa {DECIMAL-11/10}, jos hinta ilmaistaan prosentteina tai tuottona todistusten ja muiden oman pääoman ehtojen kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa
4	Puuttuva hinta	Jos hintaa ei ole raportointihetkellä saatavilla mutta asia on vireillä, kenttään merkitään arvo "PNDG". Jos hintaa ei voida soveltaa, kenttään merkitään arvo "NOAP".	RM, MTF, APA, CTP	"PNDG", jos hinta ei ole saatavilla "NOAP", jos hinta ei ole sovellettavissa
5	Hinnan valuutta	Päävaluutta, jonka määräisenä hinta ilmaistaan (sovelletaan, jos hinta ilmaistaan rahallisena arvona).	RM, MTF APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}

6	Hinnan merkintätapa	Tieto siitä, ilmaistaanko hinta rahallisena arvona, prosentteina vai tuottona.	RM, MTF APA, CTP	"MONE" – rahallinen arvo oman pääoman ehtoisten ja niiden kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa "PERC" – prosenttiosuus todistusten ja muiden oman pääoman ehtoisten kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa "YIEL" – tuotto todistusten ja muiden oman pääoman ehtoisten kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa "BAPO" – peruspisteet todistusten ja muiden oman pääoman ehtoisten kaltaisten rahoitusvälineiden tapauksessa
7	Määrä	Rahoitusvälineiden yksiköiden lukumäärä. Rahoitusvälineen nimellisarvo tai rahallinen arvo.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/17}, jos määrä ilmaistaan yksiköiden lukumääränä {DECIMAL-18/5}, jos määrä ilmaistaan rahallisena arvona tai nimellisarvona

8	Toteuttamispaikka	Sen paikan yksilöiminen, jossa toimeksianto on toteutettu. EU:n kauppapaikassa toteutetuista liiketoimista käytetään ISO 10383 -standardin mukaista ”segment MIC” -koodia. Jos ”segment MIC” -koodia ei ole olemassa, käytetään ”operating MIC” -koodia. Rahoitusvälineistä, jotka on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai joilla käydään kauppaa kauppapaikassa, käytetään koodia ”SINT”, jos rahoitusvälinettä koskeva liiketoimi toteutetaan kauppojen sisäisessä toteuttajassa. Rahoitusvälineistä, jotka on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai joilla käydään kauppaa kauppapaikassa, käytetään MIC-koodia ”XOFF”, jos rahoitusvälinettä koskevaa liiketoimea ei toteuteta EU:n kauppapaikassa eikä kauppojen sisäisessä toteuttajassa. Jos liiketoimi toteutetaan organisoidussa kauppapaikassa EU:n ulkopuolella, MIC-koodin ”XOFF” lisäksi on täytettävä kenttä ”Kolmannen maan kauppapaikka, jossa liiketoimi toteutetaan”.	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} – EU:n kauppapaikat tai ”SINT” – kauppojen sisäinen toteuttaja ”XOFF” – muussa tapauksessa
9	Kolmannen maan kauppapaikka, jossa liiketoimi toteutetaan.	Liiketoimen toteutuspaikkana toimineen kolmannen maan kauppapaikan yksilöiminen. Käytetään ISO 10383 -standardin mukaista ”segment MIC” -koodia. Jos ”segment MIC” -koodia ei ole olemassa, käytetään ”operating MIC” -koodia. Jos liiketoimea ei toteuteta kolmannen maan kauppapaikassa, kenttää jätetään tyhjäksi.	APA, CTP	{MIC}
10	Julkistamisen päivämäärä ja kellonaika	Päivämäärä ja kellonaika, joina kauppapaikka tai hyväksytty julkistamisjärjestely on julkistanut liiketoimen. Kauppapaikassa toteutettujen liiketoimien osalta tarkkuusasteen on oltava delegoidun asetuksen (EU) 2017/574 2 artiklan mukainen. Muualla kuin kauppapaikassa toteutettujen liiketoimien osalta päivämäärä ja kellonaika ilmoitetaan vähintään lähimmän sekunnin tarkkuudella.	RM, MTF, APA, CTP	{DATE_TIME_FOR MAT}

11	Julkistamispaikka	Koodi, jolla yksilöidään liiketoimen julkistava kauppapaikka tai hyväksytty julkistamisjärjestely	CTP	Kauppapaikka: {MIC} APA: ISO 10383 -standardin mukainen ”segment MIC” -koodi (4 merkkiä), jos saatavilla. Muussa tapauksessa 4-merkkinen koodi, sellaisena kuin se on julkistettu raportointipalvelujen tarjoajia koskevassa luettelossa ESMAn verkkosivustolla.
12	Liiketoimen tunnistekoodi	Aakkosnumeerinen koodi, jonka ovat antaneet kauppapaikat (komission delegoidun asetuksen (EU) 2017/580 ⁽¹⁾ 12 artiklan mukaisesti) ja hyväksytyt julkistamisjärjestelyt ja jota käytetään myöhemmissä viittauksissa kyseiseen kauppaan. Liiketoimen tunnistekoodin on oltava jokaisen ISO 10383 -standardin mukaisen ”segment MIC” -koodin sekä jokaisen kaupankäyntipäivän osalta yksilöllinen, johdonmukainen ja pysyvä. Jos kauppapaikka ei käytä ”segment MIC” -koodeja, liiketoimen tunnistekoodin on oltava jokaisen ”operating MIC” -koodin ja jokaisen kaupankäyntipäivän osalta yksilöllinen, johdonmukainen ja pysyvä. Jos hyväksytty julkistamisjärjestely ei käytä MIC-koodeja, annetaan 4-merkkinen yksilöllinen, johdonmukainen ja pysyvä koodi hyväksytyn julkistamisjärjestelyn ja kaupankäyntipäivän yksilöimiseksi. Liiketoimen tunnistekoodin komponentit eivät saa mahdollistaa sen liiketoimen vastapuolten tunnistamista, jolle kyseinen koodi on annettu.	RM, MTF, APA, CTP	{ALPHANUM-52}

(1) Komission delegoitu asetukset (EU) 2017/580, annettu 24 päivänä kesäkuuta 2016, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 600/2014 täydentämisestä rahoitusvälineitä koskeviin toimeksiantoihin liittyvien tietojen säilyttämistä koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla (ks. tämän virallisen lehden s. 193).

Taulukko 4

Luettelo kaupan jälkeiseen avoimuuteen liittyvistä merkinnöistä

Merkintä	Nimi	Toteuttamispaikan tai julkistamispaikan tyyppi	Kuvaus
”BENC”	Viitearvoon perustuvia liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF APA CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan sellaisen hinnan perusteella, joka lasketaan useina ajankohtina tietyn viitearvon mukaisesti, kuten volyymipainotettu keskihinta tai aikapainotettu keskihinta.
”NPFT”	Hinnanmuodostukseen vaikuttamattomia liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Delegoidun asetuksen (EU) 2017/590 2 artiklan 5 kohdassa tarkoitettujen hinnanmuodostukseen vaikuttamattomat liiketoimet.
”PORT”	Portfolioliiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF APA CTP	Vähintään viidellä eri rahoitusvälineellä toteutettavat liiketoimet, jotka sama asiakas toteuttaa samanaikaisesti yhtenä eränä tiettyyn viitehintaan.
”CONT”	Ehdollisia liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF APA CTP	Liiketoimet, jotka ovat riippuvaisia johdannaissopimuksen tai muun rahoitusvälineen ostosta, myynnistä, luomisesta tai lunastuksesta, jossa kaupan kaikki osat on tarkoitus toteuttaa yhtenä eränä.

”ACTX”	Välittäjän täsmäyttämiä asiakaskauppoja koskeva merkintä	APA CTP	Liiketoimet, joissa sijoituspalveluyritys on koonnut yhteen asiakkaiden toimeksiantoja ja joissa osto ja myynti toteutetaan yhtenä toimeksiantona ja niiden volyymit ja hinnat ovat samat.
”SDIV”	Erityistä osinkoliiketoimea koskeva merkintä	RM, MTF APA CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan ilman osinkoa, jolloin osinko tai muu voitto-osuus lankeaa ostajalle eikä myyjälle, tai jotka toteutetaan osinkoineen, jolloin osinko tai muu voitto-osuus lankeaa myyjälle eikä ostajalle.
”LRGS”	Kaupan jälkeen lykättyinä julkistettuja kooltaan suuria liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF APA CTP	Liiketoimet, jotka ovat suuria tavanomaiseen markkinakokoon verrattuina ja joissa julkistamista voidaan lykätä 15 artiklan nojalla.
”RFPT”	Viitehintaan perustuvia liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan a alakohdan mukaisesti toimivissa järjestelmissä.
”NLIQ”	Likvidejä rahoitusvälineitä koskevia sopimuskauppoja koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan i alakohdan mukaisesti.

”OILQ”	Epälikvidejä rahoitusvälineitä koskevia sopimuskauppoja koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan ii alakohdan mukaisesti.
”PRIC”	Muiden ehtojen kuin markkinahinnan alaisia sopimuskauppoja koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan iii alakohdan sekä 6 artiklan mukaisesti.
”ALGO”	Algoritmisia liiketoimia koskeva merkintä	RM, MTF CTP	Liiketoimet, joiden toteuttaminen johtuu siitä, että sijoituspalveluyritys harjoittaa direktiivin 2014/65/EU 4 artiklan 1 kohdan 39 alakohdassa määritettyä algoritmista kaupankäyntiä.
”SIZE”	Vakioitua markkinakokoa suurempia liiketoimia koskeva merkintä	APA CTP	Kauppojen sisäisessä toteuttajassa toteutetut liiketoimet, joissa saapuva toimeksianto on ollut kooltaan 11 artiklan mukaisesti määritettyä vakioitua markkinakokoa suurempi.
”ILQD”	Epälikvidejä rahoitusvälineitä koskevia liiketoimia koskeva merkintä	APA CTP	Komission delegoidun asetuksen (EU) 2017/567 ⁽¹⁾ 1–5 artiklan mukaisesti määritettyjä epälikvidejä rahoitusvälineitä koskevat liiketoimet, jotka toteutetaan kauppojen sisäisessä

			toteuttajassa.
”RPRI”	Paremmalla hinnalla toteutettuja liiketoimia koskeva merkintä	APA CTP	Liiketoimet, jotka toteutetaan kauppohen sisäisessä toteuttajassa paremmalla hinnalla asetuksen (EU) N:o 600/2014 15 artiklan 2 kohdan a alakohdan mukaisesti.
”CANC”	Peruutusmerkintä	RM, MTF APA CTP	Kun aiemmin julkistettu liiketoimi peruutetaan.
”AMND”	Muutosmerkintä	RM, MTF APA CTP	Kun aiemmin julkistettua liiketoimea muutetaan.
”DUPL”	Liiketoimia koskevien ilmoitusten kaksoiskappaleita koskeva merkintä	APA	Kun liiketoimesta ilmoitetaan useammalle kuin yhdelle hyväksytylle julkistamisjärjestelylle delegoidun asetuksen (EU) 2017/571 16 artiklan 1 kohdan mukaisesti.
(1) Komission delegoitu asetus (EU) 2017/567, annettu 18 päivänä toukokuuta 2016, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 600/2014 täydentämisestä määritelmien, avoimuuden, sijoitussalkun tiivistämisen sekä tuotteita koskeviin interventioihin ja positioiden hallintaan kohdistettavien valvontatoimenpiteiden osalta (katso tämän virallisen lehden sivu 90).			

”

LIITE II

Korvataan delegoidun asetuksen (EU) 2017/587 liitteessä II oleva taulukko 5 seuraavasti:

”Taulukko 5

Pörssilistattuja rahastoja koskevat lykätyn julkistamisen kynnysarvot ja määräajat

Julkistamisen lykkäämiseen vaadittu liiketoimen vähimmäiskoko euroina	Julkistamisen määräaika liiketoimen jälkeen
15 000 000	60 minuuttia
50 000 000	Kaupankäyntipäivän päättyessä

”

LIITE III

”LIITE IV

Tiedot, jotka on toimitettava likviditeetillä mitattuna merkittävimmän markkinan, keskimääräisen päivävaihdon (KPV) ja liiketoimien keskimääräisen arvon (LKA) määrittämiseksi

Taulukko 1

Symbolitaulukko

Symboli	Tietotyyppi	Määritelmä
{ALPHANUM-n}	Enintään n aakkosnumeerista merkkiä	Vapaa tekstikenttä
{ISIN}	12 aakkosnumeerista merkkiä	ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-koodi.
{MIC}	4 aakkosnumeerista merkkiä	ISO 10383 -standardin mukainen kaupankäyntipaikan koodi.
{DATEFORMAT}	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa.	Päivämäärät esitetään seuraavassa muodossa: VVVV-KK-PP.
{DECIMAL-n/m}	Desimaaliluku, jossa on yhteensä enintään n numeroa, joista enintään m numeroa voi olla desimaaleja	Numerokenttä, jossa voi olla sekä positiivisia että negatiivisia arvoja. Desimaalierotin on ”.” (piste). Negatiivisten lukujen edessä on ”-” (miinusmerkki). Arvot pyöristetään, eikä niitä lyhennetä.
{INTEGER-n}	Kokonaisluku, jossa on yhteensä enintään n numeroa.	Numerokenttä, jossa voi olla sekä positiivisia että negatiivisia kokonaislukujen arvoja.

Taulukko 2

Tiedot, jotka on toimitettava likviditeetillä mitattuna merkittävimmän markkinan, keskimääräisen päivävaihdon (KPV) ja liiketoimien keskimääräisen arvon (LKA) määrittämiseksi (nykyisten raportointiohjeiden perusteella)

Kentän numero	Kentän tunniste	Kuvaus ja julkistettavat tiedot	Toteuttamispaikan julkistamispaikan tyyppi	Taulukon mukaisesti käytettävä muoto	1
---------------	-----------------	---------------------------------	--	--------------------------------------	---

1	Rahoitusvälineen tunnistekoodi	Koodi, jolla rahoitusväline yksilöidään	Säännelty markkina (RM) Monenkeskinen kaupankäyntijärjestelmä (MTF) Hyväksytty julkistamisjärjestely (APA) Konsolidoitujen kauppätietojen tarjoaja (CTP)	{ISIN}
2	Toteutuspäivä	Päivä, jona kaupat toteutetaan.	RM, MTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}
3	Toteuttamispaikka	Kauppapaikan tai kauppajen sisäisen toteuttajan ”segment MIC” -koodi, jos sellainen on saatavilla. Muussa tapauksessa ”operating MIC” -koodi. MIC-koodi ”XOFF”, jos liiketoimen toteuttavat sijoituspalveluyritykset, jotka eivät ole kauppajien sisäisiä toteuttajia, ja liiketoimea ei toteuteta kauppapaikassa.	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} – kauppapaikan tai kauppajien sisäisen toteuttajan MIC-koodi tai MIC-koodi ”XOFF”.
4	Keskeytyksen kohteena olevaa rahoitusvälinettä koskeva merkintä	Osoittaa, onko kaupankäynti rahoitusvälineellä keskeytetty toteutuspäivänä koko kaupankäyntipäivän ajaksi asianomaisessa kauppapaikassa. Jos kaupankäynti on keskeytetty koko kaupankäyntipäivän ajaksi, kenttiin 5–10 merkitään arvoksi nolla.	RM, MTF, CTP	TRUE – jos kaupankäynti rahoitusvälineellä on keskeytetty koko kaupankäyntipäivän ajaksi tai FALSE – jos kaupankäyntiä rahoitusvälineellä ei ole keskeytetty koko kaupankäyntipäivän
5	Liiketoimien kokonaislukumäärä	Toteutuspäivänä toteutettujen liiketoimien kokonaislukumäärä. (**)	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Kokonaisliikevaihto	Toteutuspäivänä toteutetun kokonaisliikevaihto euroina. (*) (**)	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

7	Toteutetut liiketoimet, lukuun ottamatta kaikkia liiketoimia, jotka on toteutettu asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan a, b ja c alakohdassa	Toteutuspäivänä toteutettujen liiketoimien kokonaislukumäärä, lukuun ottamatta kaikkia liiketoimia, jotka on toteutettu samana päivänä asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan a, b ja c alakohdassa säädettyjen kauppaa edeltävien vapautusten mukaisesti. (**)	RM, MTF, CTP	{INTEGER-18}
8	Toteutunut kokonaisliikevaihto, lukuun ottamatta kaikkia liiketoimia, jotka on toteutettu asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan a, b ja c alakohdassa	Toteutuspäivänä toteutunutta kokonaisliikevaihtoa, lukuun ottamatta kaikkia liiketoimia, jotka on toteutettu samana päivänä asetuksen (EU) N:o 600/2014 4 artiklan 1 kohdan a, b ja c alakohdassa säädettyjen kauppaa edeltävien vapautusten mukaisesti. (*) (**)	RM, MTF, CTP	{DECIMAL-18/5}
9	Liiketoimien kokonaislukumäärä, lukuun ottamatta liiketoimia, joiden toteutuksessa on sovellettu kaupan jälkeistä suureen kokoon perustuvaa lykkäystä.	Toteutuspäivänä toteutettujen liiketoimien kokonaislukumäärä, lukuun ottamatta liiketoimia, jotka on toteutettu suureen kokoon perustuvan (kaupan jälkeisen) vapautuksen mukaisesti. (**) Osakkeita ja talletustodistuksia koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevan taulukon 4 mukaista asiaankuuluvaa keskimääräistä päivävaihtoa (KPV) koskevaa suurinta kynnysarvoa. Todistuksia ja muita samankaltaisia rahoitusvälineitä koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevassa taulukossa 6 esitettyä suurinta kynnysarvoa. Pörssilistattuja rahastoja koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevassa taulukossa 5 esitettyä suurinta kynnysarvoa.	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}

10	Toteutunut kokonaisliikevaihto, lukuun ottamatta liiketoimia, joiden toteutuksessa on sovellettu kaupan jälkeistä suureen kokoon perustuvaa lykkäystä.	Toteutuspäivänä toteutettujen liiketoimien volyymi, lukuun ottamatta liiketoimia, joiden toteutuksessa on sovellettu (kaupan jälkeistä) suureen kokoon perustuvaa lykkäystä. (*) (**) Osakkeita ja talletustodistuksia koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevan taulukon 4 mukaista asiaankuuluvaa keskimääräistä päivävaihtoa (KPV) koskevaa suurinta kynnysarvoa. Todistuksia ja muita samankaltaisia rahoitusvälineitä koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevassa taulukossa 6 esitettyä suurinta kynnysarvoa. Pörssilistattuja rahastoja koskevien liiketoimien yksilöimiseksi on käytettävä ainoastaan liitteessä II olevassa taulukossa 5 esitettyä suurinta kynnysarvoa.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}
----	--	--	-------------------	----------------

(*) Liikevaihto lasketaan kertomalla ostajien ja myyjien välillä vaihdettujen rahoitusvälineiden lukumäärä kyseisessä liiketoimessa vaihdetun rahoitusvälineen yksikköhinnalla, ja se ilmaistaan euroina.

(**) Peruutetut liiketoimet on jätettävä pois raportoitavista luvuista.

Kaikissa tapauksissa kenttään on merkittävä arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia.

”