

Bruksela, 30 stycznia 2023 r.
(OR. pl)

5836/23
ADD 1

EF 29
ECOFIN 83
DELECT 14

PISMO PRZEWODNIE

Od:	Sekretarz generalna Komisji Europejskiej (podpisała dyrektor Martine DEPREZ)
Data otrzymania:	27 stycznia 2023 r.
Do:	Thérèse BLANCHET, sekretarz generalna Rady Unii Europejskiej
Nr dok. Kom.:	C(2023) 245 final
Dotyczy:	ZAŁĄCZNIKI do ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../... w sprawie zmiany i sprostowania regulacyjnych standardów technicznych określonych w rozporządzeniu delegowanym (UE) 2017/587 w odniesieniu do niektórych wymogów w zakresie przejrzystości mających zastosowanie do transakcji na instrumentach udziałowych

Delegacje otrzymują w załączeniu dokument C(2023) 245 final.

Zał.: C(2023) 245 final



KOMISJA
EUROPEJSKA

Bruksela, dnia 17.1.2023 r.
C(2023) 245 final

ANNEXES 1 to 3

ZAŁĄCZNIKI

do

ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../...

**w sprawie zmiany i sprostowania regulacyjnych standardów technicznych określonych
w rozporządzeniu delegowanym (UE) 2017/587 w odniesieniu do niektórych wymogów w
zakresie przejrzystości mających zastosowanie do transakcji na instrumentach
udziałowych**

ZAŁĄCZNIK I

W załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/587 wprowadza się następujące zmiany:

1) tabela 1 otrzymuje brzmienie:

„Tabela 1

Opis rodzaju systemów transakcyjnych oraz odnośnych informacji podawanych do wiadomości publicznej zgodnie z art. 3

Wiersz	Rodzaj systemu transakcyjnego	Opis systemu transakcyjnego	Informacje podawane do wiadomości publicznej
1	System transakcyjny oparty na arkuszu zleceń realizowanych w trybie notowań ciągłych	System, który w oparciu o arkusz zleceń i algorytm transakcyjny funkcjonujący bez udziału człowieka zestawia w sposób ciągły zlecenia sprzedaży ze zleceniami kupna w oparciu o najlepszą dostępną cenę.	Łączna liczba zleceń oraz akcji, kwitów depozytowych, jednostek funduszy inwestycyjnych typu ETF, certyfikatów oraz innych podobnych instrumentów finansowych, których dotyczą te zlecenia na każdym poziomie cenowym dla przynajmniej pięciu najlepszych poziomów cen kupna i cen sprzedaży.
2	System transakcyjny oparty na kwotowaniach cen	System, w którym transakcje zawiera się na podstawie gwarantowanych kwotowań, które udostępnia się uczestnikom w sposób ciągły, wymagający od animatorów rynku utrzymywania kwotowań w zakresie pozwalającym na zachowanie równowagi między potrzebami członków i uczestników, jeśli chodzi o zawieranie transakcji w skali komercyjnej, a ryzykiem, na jakie naraża się animator rynku.	Najlepsza cena kupna i sprzedaży oferowana przez każdego animatora rynku dla akcji, kwitów depozytowych, funduszy inwestycyjnych typu ETF, certyfikatów oraz innych podobnych instrumentów finansowych będących przedmiotem obrotu w systemie transakcyjnym, wraz z wolumenem odpowiadającym tym cenom. Kwotowania podawane do publicznej wiadomości to kwotowania, które stanowią wiążące zobowiązanie do sprzedaży lub kupna instrumentów finansowych i które wskazują cenę instrumentów finansowych, po jakiej zarejestrowani animatorzy rynku są gotowi je kupić lub sprzedać, oraz wolumen instrumentów finansowych, który animatorzy ci są gotowi kupić lub sprzedać. W wyjątkowych warunkach rynkowych dopuszcza się jednak przez ograniczony czas publikowanie cen orientacyjnych lub jednostronnych (tylko kupna lub tylko sprzedaży).
3	System transakcyjny oparty na okresowych fazach ustalania kursu jednolitego	System, który zestawia zlecenia w oparciu o okresowe fazy ustalania kursu jednolitego i algorytm transakcyjny funkcjonujący bez udziału człowieka.	Cena, przy której system transakcyjny stosujący fazy ustalania kursu jednolitego najpełniej zrealizuje założenia algorytmu transakcyjnego dla akcji, kwitów depozytowych, funduszy inwestycyjnych typu ETF, certyfikatów i innych podobnych instrumentów finansowych będących przedmiotem obrotu w tym systemie, a także wolumen, który uczestnicy mogliby potencjalnie zrealizować w tym systemie po tej cenie.

4	System transakcyjny zapytań o kwotowanie	System, w którym kwotowanie lub kwotowania są przekazywane w odpowiedzi na zapytanie o kwotowanie złożone przez jednego członka lub uczestnika lub większą ich liczbę. Kwotowanie podlega wykonaniu wyłącznie przez członka lub uczestnika, który wystosował zapytanie. Członek lub uczestnik, który wystosował zapytanie, może zawrzeć transakcję poprzez przyjęcie kwotowania lub kwotowań przekazanych mu w odpowiedzi na jego zapytanie.	Kwotowania i wiążące się z nimi wolumeny udostępnione przez dowolnego członka lub uczestnika, które, jeżeli zostaną przyjęte, skutkowałyby zawarciem transakcji zgodnie z zasadami systemu. Wszystkie kwotowania przekazane w odpowiedzi na zapytanie o kwotowanie mogą być publikowane w tym samym czasie, przy czym nie później niż w momencie, gdy stają się wykonalne.
5	Hybrydowy system transakcyjny	System, który obejmuje co najmniej dwa rodzaje systemów transakcyjnych, o których mowa w wierszach 1–4 niniejszej tabeli.	W przypadku systemów hybrydowych, które łączą w sobie równoległe różne systemy transakcyjne, stosowne wymogi odpowiadają wymogom w zakresie przejrzystości przedtransakcyjnej mającym zastosowanie do każdego rodzaju systemu transakcyjnego, który składa się na system hybrydowy. W przypadku systemów hybrydowych, które łączą w sobie szeregowo co najmniej dwa systemy transakcyjne, stosowne wymogi odpowiadają wymogom w zakresie przejrzystości przedtransakcyjnej mającym zastosowanie do odpowiedniego systemu transakcyjnego eksploatowanego w określonym momencie.
6	Wszelkie inne systemy transakcyjne	Każdy inny rodzaj systemu transakcyjnego nieujęty w wierszach 1–5.	Odpowiednie informacje na temat poziomu zleceń lub kwotowań oraz poziomu zainteresowania zawarciem transakcji dla akcji, kwitów depozytowych, funduszy inwestycyjnych typu ETF, certyfikatów i innych podobnych instrumentów finansowych będących przedmiotem obrotu w danym systemie transakcyjnym; w szczególności poziomy pięciu najlepszych cen kupna i sprzedaży lub kwotowań kupna i sprzedaży oferowanych przez każdego animatora rynku prowadzącego obrót danym instrumentem, o ile pozwalają na to właściwości mechanizmu ustalania poziomu cen równowagi na podstawie czynników podaży i popytu.

”;

2) tabele 3 i 4 otrzymują brzmienie:

Wykaz szczegółowych informacji do celów przejrzystości posttransakcyjnej

Lp.	Identyfikator pola	Opis i szczegółowe informacje podlegające publikacji	Rodzaj miejsca wykonania lub publikacji transakcji	Format przekazywanych informacji, jak określono w tabeli 2
1	Data i godzina transakcji	Data i godzina wykonania transakcji. W przypadku transakcji wykonywanych w systemie obrotu poziom szczegółowości musi być zgodny z wymogami określonymi w art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574. W przypadku transakcji niewykonywanych w systemie obrotu – data i godzina uzgodnienia przez strony treści następujących pól: ilość, cena, waluty jak określono w polach 31, 34 i 44 tabeli 2 w załączniku I do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/590, kod identyfikacyjny instrumentu, klasyfikacja instrumentu i kod instrumentu bazowego, w stosownych przypadkach. W przypadku transakcji niewykonywanych w systemie obrotu zgłaszany czas podaje się z dokładnością przynajmniej do pełnej sekundy. W przypadku gdy transakcja jest wynikiem zlecenia przekazanego osobie trzeciej przez firmę realizującą zlecenie w imieniu klienta, w sytuacji gdy warunki przekazania zlecenia określone w art. 4 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590 nie zostały spełnione, podaje się datę i godzinę zawarcia transakcji, a nie godzinę przekazania zlecenia.	Rynek regulowany (RM) Wielostronna platforma obrotu (MTF) Zatwierdzony podmiot publikujący (APA) Dostawca informacji skonsolidowanych (CTP)	{DATE_TIME_FORMAT}
2	Kod identyfikacyjny instrumentu	Kod stosowany do identyfikacji instrumentu finansowego.	RM, MTF, APA, CTP	{ISIN}
3	Cena	Cena, po której zawarto transakcję, z wyłączeniem, w stosownych przypadkach, prowizji i naliczonych odsetek. W przypadku gdy cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej. W przypadku gdy cena nie jest obecnie dostępna, ale jej ustalanie jest w toku (»PNDG«) lub cena nie ma zastosowania (»NOAP«), pola tego nie wypełnia się.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/13} – gdy cena jest wyrażona jako wartość pieniężna w przypadku udziałowych instrumentów finansowych i instrumentów finansowych o cechach instrumentów udziałowych {DECIMAL-11/10} – gdy cena jest wyrażona jako wartość procentowa lub stopa zwrotu w przypadku certyfikatów i innych instrumentów

				finansowych o cechach instrumentów udziałowych
4	Brakująca cena	W przypadku gdy cena nie jest obecnie dostępna, ale jej ustalanie jest w toku, należy wpisać »PNDG«. W przypadku gdy cena nie ma zastosowania, należy wpisać »NOAP«.	RM, MTF, APA, CTP	»PNDG« – jeżeli cena jest niedostępna »NOAP« – jeżeli cena nie ma zastosowania
5	Waluta ceny	Jednostka waluty głównej, w jakiej wyrażona jest cena (ma zastosowanie, jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna).	RM, MTF, APA, CTP	{CURRENCYCOD E_3}
6	Oznaczenie ceny	Określenie, czy cena jest wyrażona w wartości pieniężnej, jako wartość procentowa czy jako stopa zwrotu.	RM, MTF, APA, CTP	»MONE« – wartość pieniężna w przypadku udziałowych instrumentów finansowych i instrumentów finansowych o cechach instrumentów udziałowych »PERC« – wartość procentowa w przypadku certyfikatów i innych instrumentów finansowych o cechach instrumentów udziałowych »YIEL« – stopa zwrotu w przypadku certyfikatów i innych instrumentów finansowych o cechach instrumentów udziałowych »BAPO« – punkty bazowe w przypadku certyfikatów i innych instrumentów finansowych o cechach instrumentów udziałowych

7	Ilość	Liczba jednostek instrumentu finansowego. Wartość nominalna lub pieniężna instrumentu finansowego.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
8	Miejsce wykonania transakcji	Oznaczenie miejsca wykonania transakcji. Należy stosować kod MIC segmentu zgodny z normą ISO 10383 w przypadku transakcji wykonywanych w unijnym systemie obrotu. Jeżeli kod MIC segmentu nie istnieje, należy stosować operacyjny MIC. W odniesieniu do instrumentów finansowych dopuszczonych do obrotu lub będących przedmiotem obrotu w systemie obrotu należy użyć kodu »SINT«, jeżeli transakcja na danym instrumencie finansowym jest wykonywana za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje. W odniesieniu do instrumentów finansowych dopuszczonych do obrotu lub będących przedmiotem obrotu w systemie obrotu należy użyć kodu »XOFF«, jeżeli transakcja na danym instrumencie finansowym nie jest wykonywana ani w unijnym systemie obrotu, ani za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje. Jeżeli transakcja jest wykonywana na zorganizowanej platformie obrotu poza UE, oprócz podania kodu MIC »XOFF« należy wówczas również wypełnić pole »System obrotu państwa trzeciego jako miejsce wykonania transakcji«.	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} – unijne systemy obrotu lub »SINT« – podmiot systematycznie internalizujący transakcje »XOFF« – w innym przypadku
9	System obrotu państwa trzeciego jako miejsce wykonania transakcji	Oznaczenie systemu obrotu państwa trzeciego, w którym to systemie wykonano transakcję. Należy stosować kod MIC segmentu zgodny z normą ISO 10383. Jeżeli kod MIC segmentu nie istnieje, należy podać operacyjny MIC. W przypadku gdy transakcja nie jest wykonywana w systemie obrotu państwa trzeciego, pola tego nie wypełnia się.	APA, CTP	{MIC}
10	Data i godzina publikacji	Data i godzina publikacji transakcji przez system obrotu lub zatwierdzony podmiot publikujący. W przypadku transakcji wykonywanych w systemie obrotu poziom szczegółowości musi być zgodny z wymogami określonymi w art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574. W przypadku transakcji niewykonywanych w systemie obrotu datę i godzinę podaje się z dokładnością przynajmniej do pełnej sekundy.	RM, MTF, APA, CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Miejsce publikacji	Kod stosowany do identyfikacji systemu obrotu lub zatwierzonego podmiotu publikującego, który	CTP	System obrotu: {MIC} Zatwierdzony podmiot

		publikuje transakcję.		publikujący: kod MIC segmentu zgodny z ISO 10383 (4 znaki), jeżeli istnieje. W innym przypadku – 4-znakowy kod opublikowany w wykazie dostawców usług w zakresie udostępniania informacji na stronie internetowej ESMA.
12	Kod identyfikacyjny transakcji	Alfanumeryczny kod nadany przez systemy obrotu (zgodnie z art. 12 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/580⁽¹⁾) i zatwierdzone podmioty publikujące, który jest stosowany w każdym późniejszym odwołaniu do danej transakcji. Kod identyfikacyjny transakcji jest niepowtarzalny, konsekwentnie stosowany i trwały w odniesieniu do zgodnego z normą ISO 10383 kodu MIC segmentu rynku i do każdego dnia sesyjnego. Jeżeli system obrotu nie stosuje kodów MIC segmentów, kod identyfikacyjny transakcji musi być niepowtarzalny, konsekwentnie stosowany i trwały w odniesieniu do każdego operacyjnego MIC i do każdego dnia sesyjnego. Jeżeli zatwierdzony podmiot publikujący nie stosuje kodów MIC, użyty kod musi być niepowtarzalny, konsekwentnie stosowany i trwały w odniesieniu do każdego 4-znakowego kodu stosowanego do identyfikacji danego zatwierdzonego podmiotu publikującego i do każdego dnia sesyjnego. Elementy składowe kodu identyfikacyjnego transakcji nie mogą zdradzać tożsamości stron transakcji, dla której przyjęto dany kod.	RM, MTF, APA, CTP	{ALPHANUM-52}

(1) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/580 z dnia 24 czerwca 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie przechowywania właściwych danych dotyczących zleceń, których przedmiotem są instrumenty finansowe (zob. s. 193 niniejszego Dziennika Urzędowego).

Tabela 4

Wykaz znaczników do celów przejrzystości posttransakcyjnej

Znacznik	Nazwa	Rodzaj miejsca wykonania lub publikacji transakcji	Opis
»BENC«	Znacznik transakcji	RM, MTF	Transakcje wykonywane w oparciu o cenę, która

	referencyjnych	APA CTP	jest wyliczana wielokrotnie w czasie według danej wartości referencyjnej, takiej jak średnia cena ważona wolumenem lub średnia cena ważona czasowo.
»NPFT«	Znacznik transakcji niewpływających na poziom ceny	RM, MTF CTP	Transakcje niewpływające na poziom ceny, o których mowa w art. 2 ust. 5 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590.
»PORT«	Znacznik transakcji portfelowych	RM, MTF APA CTP	Transakcje, których przedmiotem jest co najmniej pięć różnych instrumentów finansowych, w przypadku gdy transakcje te są zawierane w tym samym czasie przez tego samego klienta w ramach jednego pakietu w oparciu o określoną cenę referencyjną.
»CONT«	Znacznik transakcji warunkowych	RM, MTF APA CTP	Transakcje, które są uzależnione od zakupu, sprzedaży, utworzenia lub wykupu instrumentu pochodnego lub innego instrumentu finansowego, w przypadku gdy wszystkie części składowe transakcji mają być wykonane w ramach jednego pakietu.
»ACTX«	Znacznik transakcji	APA	Transakcje, w których firma inwestycyjna

	opartych o zlecenia typu »cross«	CTP	konsoliduje zlecenia klientów w ten sposób, że poszczególne zlecenia sprzedaży i zakupu realizowane są jako pojedyncza transakcja przy tym samym wolumenie i po tej samej cenie.
»SDIV«	Znacznik transakcji dających prawo do dywidendy specjalnej	RM, MTF APA CTP	Transakcje, które: wykonano w okresie po ostatnim dniu uprawniającym do nabycia akcji z prawem do dywidendy, w przypadku których prawa do dywidendy lub innej formy podziału zysku nabywa kupujący, a nie sprzedający, lub wykonano w okresie upływającym w ostatnim dniu uprawniającym do nabycia akcji z prawem do dywidendy włącznie, w przypadku których prawa do dywidendy lub innej formy podziału zysku nabywa sprzedający, a nie kupujący.
»LRGS«	Znacznik zrealizowanej transakcji o dużej skali	RM, MTF APA CTP	Transakcje, których skala jest duża w porównaniu ze standardową wielkością rynkową, w przypadku których dopuszczono odroczoną publikację na podstawie art. 15.
»RFPT«	Znacznik transakcji z kursem	RM, MTF CTP	Transakcje, które wykonano w systemach funkcjonujących zgodnie

	odniesienia		z art. 4 ust. 1 lit. a) rozporządzenia (UE) nr 600/2014.
»NLIQ«	Znacznik transakcji negocjowanej na płynnych instrumentach finansowych	RM, MTF CTP	Transakcje wykonane zgodnie z art. 4 ust. 1 lit. b) pkt (i) rozporządzenia (UE) nr 600/2014.
»OILQ«	Znacznik transakcji negocjowanej na niepłynnych instrumentach finansowych	RM, MTF CTP	Transakcje wykonane zgodnie z art. 4 ust. 1 lit. b) pkt (ii) rozporządzenia (UE) nr 600/2014.
»PRIC«	Znacznik transakcji negocjowanej podlegającej warunkom innym niż bieżąca cena rynkowa	RM, MTF CTP	Transakcje wykonane zgodnie z art. 4 ust. 1 lit. b) pkt (iii) rozporządzenia (UE) nr 600/2014 oraz w trybie określonym w art. 6.
»ALGO«	Znacznik transakcji algorytmicznej	RM, MTF CTP	Transakcje wykonane w wyniku prowadzenia przez firmę inwestycyjną handlu algorytmicznego w rozumieniu art. 4 ust. 1 pkt 39 dyrektywy 2014/65/UE.
»SIZE«	Znacznik transakcji powyżej standardowej wielkości rynkowej	APA CTP	Transakcje wykonane za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje, w przypadku których wielkość otrzymanego zlecenia była powyżej standardowej wielkości rynkowej ustalonej

			zgodnie z art. 11.
»ILQD«	Znacznik transakcji na nie płynnym instrumencie	APA CTP	Transakcje na nie płynnych instrumentach, określonych zgodnie z art. 1–5 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/567 ⁽¹⁾ , wykonane za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje.
»RPRI«	Znacznik transakcji wykonanych po korzystniejszej cenie	APA CTP	Transakcje wykonane za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje, które wykonano po korzystniejszej cenie zgodnie z art. 15 ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 600/2014.
»CANC«	Znacznik anulowania	RM, MTF APA CTP	Stosowany w przypadku anulowania uprzednio opublikowanej transakcji.
»AMND«	Znacznik zmiany	RM, MTF APA CTP	Stosowany w przypadku zmiany uprzednio opublikowanej transakcji.
»DUPL«	Znacznik wielokrotnych zgłoszeń	APA	Stosowany w przypadku, gdy transakcja zgłaszana jest do co najmniej

	transakcji		dwóch zatwierdzonych podmiotów publikujących zgodnie z art. 16 ust. 1 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/571.
(1) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/567 z dnia 18 maja 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do definicji, przejrzystości, kompresji portfela i środków nadzorczych w zakresie interwencji produktowej i pozycji (zob. s. 90 niniejszego Dziennika Urzędowego).			

”

ZAŁĄCZNIK II

W załączniku II do rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/587 tabela 5 otrzymuje brzmienie:

„Tabela 5

Progi i opóźnienia związane z odroczoną publikacją dla funduszy inwestycyjnych typu ETF

Minimalna kwalifikująca się wielkość transakcji w EUR, dla której dopuszcza się opóźnienie publikacji	Maksymalne opóźnienie publikacji po wykonaniu transakcji
15 000 000	60 minut
50 000 000	Koniec dnia sesyjnego

”

ZAŁĄCZNIK III

„ZAŁĄCZNIK IV

Dane, które należy przekazywać do celów określenia najbardziej właściwego rynku w sensie płynności, ŚDO i ŚWT

Tabela 1

Tabela symboli

Symbol	Rodzaj danych	Definicja
{ALPHANUM-n}	Do n znaków alfanumerycznych	Pole na tekst dowolny
{ISIN}	12 znaków alfanumerycznych	Kod ISIN zgodnie z ISO 6166.
{MIC}	4 znaki alfanumeryczne	Kod identyfikacyjny rynku zgodnie z ISO 10383.
{DATEFORMAT}	Format daty zgodnie z ISO 8601	Daty muszą mieć następujący format: RRRR-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Liczba dziesiętna złożona z maksymalnie n cyfr łącznie, z czego maksymalnie m cyfr mogą stanowić cyfry części ułamkowej	Pole numeryczne zarówno dla wartości dodatnich, jak i ujemnych. Separatorem dziesiętnym jest »,« (przecinek). Liczby ujemne są poprzedzone znakiem »-« (minus). Podaje się wartości zaokrąglone, ale nie okrojone.
{INTEGER-n}	Liczba całkowita złożona z maksymalnie n cyfr	Pole numeryczne dla liczb całkowitych zarówno dodatnich, jak i ujemnych.

Tabela 2

Szczegółowe informacje, które należy przekazywać do celów określenia najbardziej właściwego rynku w sensie płynności, ŚDO i ŚWT (w oparciu o aktualne instrukcje dotyczące przekazywania informacji)

Numer pola	Identyfikator pola	Opis i szczegółowe informacje podlegające publikacji	Rodzaj miejsca wykonania lub publikacji transakcji	Format przekazywanych informacji, jak określono w tabeli 1
1	Kod identyfikacyjny instrumentu	Kod stosowany do identyfikacji instrumentu finansowego.	Rynek regulowany (RM) Wielostronna platforma obrotu	{ISIN}

			(MTF) Zatwierdzony podmiot publikujący (APA) Dostawca informacji skonsolidowanych (CTP)	
2	Data wykonania	Data wykonania transakcji.	RM, MTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}
3	Miejsce wykonania transakcji	Kod MIC segmentu dla unijnego systemu obrotu lub podmiotu systematycznie internalizującego transakcje, jeśli jest dostępny; w innym przypadku operacyjny MIC. MIC XOFF, w przypadku gdy transakcja jest wykonywana przez firmy inwestycyjne, które nie są podmiotami systematycznie internalizującymi transakcje, i nie jest wykonywana w systemie obrotu.	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} systemu obrotu lub podmiotu systematycznie internalizującego transakcje lub {MIC} – XOFF
4	Znacznik zawieszenia instrumentu	Wskazuje, czy instrument był zawieszony przez cały dzień sesyjny w danym systemie obrotu w dacie wykonania. W związku z zawieszeniem instrumentu przez cały dzień sesyjny pola 5–10 zgłasza się z wartością zerową.	RM, MTF, CTP	TRUE – jeżeli instrument był zawieszony przez cały dzień sesyjny lub FALSE – jeżeli instrument nie był zawieszony przez cały dzień sesyjny
5	Całkowita liczba transakcji	Całkowita liczba transakcji wykonanych w dacie wykonania. (**)	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Całkowite obroty	Całkowite obroty zrealizowane w dacie wykonania, wyrażone w EUR. (*) (**)	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}
7	Wykonane transakcje, z wyłączeniem wszystkich transakcji objętych zwolnieniami z przejrzystości przedtransakcyjnej przewidzianymi w art. 4 ust. 1 lit. a), b) i c) rozporządzenia (UE) nr 600/2014	Całkowita liczba transakcji wykonanych w dacie wykonania, z wyłączeniem wszystkich wykonanych w tym samym dniu transakcji objętych zwolnieniami z przejrzystości przedtransakcyjnej przewidzianymi w art. 4 ust. 1 lit. a), b) i c) rozporządzenia (UE) nr 600/2014. (**)	RM, MTF, CTP	{INTEGER-18}
8	Całkowite	Całkowite obroty zrealizowane w dacie	RM, MTF, CTP	{DECIMAL-18/5}

	zrealizowane obroty, z wyłączeniem wszystkich transakcji objętych zwolnieniami z przejrzystości przedtransakcyjnej przewidzianymi w art. 4 ust. 1 lit. a), b) i c) rozporządzenia (UE) nr 600/2014	wykonania, z wyłączeniem wszystkich wykonanych w tym samym dniu transakcji objętych zwolnieniami z przejrzystości przedtransakcyjnej przewidzianymi w art. 4 ust. 1 lit. a), b) i c) rozporządzenia (UE) nr 600/2014. (*) (**)		
9	Całkowita liczba transakcji, z wyłączeniem wykonanych transakcji korzystających z odroczenia publikacji informacji posttransakcyjnych ze względu na dużą skalę	Całkowita liczba transakcji wykonanych w dacie wykonania, z wyłączeniem wykonanych transakcji korzystających ze zwolnienia (z przejrzystości posttransakcyjnej) ze względu na dużą skalę. (**) W przypadku akcji i kwitów depozytowych do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg dla odpowiedniego przedziału średnich dziennych obrotów (ŚDO) w tabeli 4 w załączniku II. W przypadku certyfikatów i innych podobnych instrumentów finansowych do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg w tabeli 6 w załączniku II. W przypadku funduszy inwestycyjnych typu ETF do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg w tabeli 5 w załączniku II.	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
10	Całkowite zrealizowane obroty, z wyłączeniem wykonanych transakcji korzystających z odroczenia publikacji informacji posttransakcyjnych ze względu na dużą skalę	Całkowity wolumen transakcji wykonanych w dacie wykonania, z wyłączeniem wykonanych transakcji korzystających ze zwolnienia (z przejrzystości posttransakcyjnej) ze względu na dużą skalę. (*) (**) W przypadku akcji i kwitów depozytowych do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg dla odpowiedniego przedziału średnich dziennych obrotów (ŚDO) w tabeli 4 w załączniku II. W przypadku certyfikatów i innych podobnych instrumentów finansowych do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg w tabeli 6 w załączniku II. W przypadku funduszy inwestycyjnych	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

		typu ETF do identyfikacji tych transakcji stosuje się tylko najwyższy próg w tabeli 5 w załączniku II.		
--	--	--	--	--

(*) Obroty oblicza się jako liczbę instrumentów wymienionych między kupującymi i sprzedającymi pomnożoną przez cenę jednostkową instrumentu wymienionego w ramach danej transakcji i wyraża się w EUR.

(**) Transakcji, które anulowano, nie uwzględnia się w zgłaszanych danych liczbowych.

We wszystkich przypadkach w polu tym należy podać wartość nie mniejszą niż zero, liczącą maksymalnie 18 znaków numerycznych, w tym maksymalnie 5 miejsc po przecinku.

”.