

**REGULAMENTUL DE PUNERE ÎN APLICARE (UE) 2017/1093 AL COMISIEI****din 20 iunie 2017****de stabilire a standardelor tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește formatul rapoartelor privind pozițiile utilizat de către firmele de investiții și operatorii de piață****(Text cu relevanță pentru SEE)**

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Directiva 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare <sup>(1)</sup>, în special articolul 58 alineatul (5),

întrucât:

- (1) Formatul pentru raportul săptămânal privind pozițiile agregate deținute de diferite categorii de persoane în diferite instrumente financiare derivate pe mărfuri ori certificate de emisii sau instrumente financiare derivate pe acestea, tranzacționate în locuri de tranzacționare, ar trebui să evidențieze separat pozițiile care pot reduce, într-un mod ce poate fi obiectiv evaluat, riscurile legate direct de activitățile comerciale, celelalte poziții și numărul total de poziții pentru a se asigura transparența în ceea ce privește diferențierea activităților conexe financiare de cele nefinanciare având ca obiect instrumentele respective.
- (2) Formatul rapoartelor zilnice care prezintă defalcarea completă a pozițiilor firmelor de investiții și ale clienților acestora în instrumente financiare derivate pe mărfuri ori certificate de emisii sau instrumente financiare derivate pe acestea, tranzacționate în locuri de tranzacționare, și în contracte extrabursiere echivalente din punct de vedere economic ar trebui să fie structurat astfel încât să se asigure monitorizarea și aplicarea limitelor pozițiilor menționate la articolul 57 din Directiva 2014/65/UE.
- (3) Pozițiile generate de marja tranzacțiilor de cumpărare și de vânzare între date de livrare diferite sau mărfuri diferite ori ca urmare a altor strategii complexe ar trebui să fie raportate pe bază neagregată, cu excepția cazului în care combinația de produse este tranzacționată ca un singur instrument financiar, identificat printr-un cod ISIN, iar pozițiilor deținute în acesta li se aplică o limită specifică.
- (4) Pentru a-și exercita atribuțiile efectiv și consecvent, autoritățile relevante și Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe (ESMA) ar trebui să dispună de date comparabile privind toate firmele de investiții și toți operatorii de piață care exploatează locurile de tranzacționare. Utilizarea unui format comun la nivelul diferitelor infrastructuri ale piețelor financiare facilitează utilizarea mai intensă a acestuia de către foarte multe tipuri de participanți din piață, promovându-se astfel standardizarea.
- (5) Pentru a facilita prelucrarea automatizată și reducerea costurilor pentru participanții din piață, ar trebui utilizate formate standard de către toate firmele de investiții și de către toți operatorii de piață care exploatează locurile de tranzacționare.
- (6) Noua legislație a Parlamentului European și a Consiliului privind piețele instrumentelor financiare prevăzută de Directiva 2014/65/UE și de Regulamentul (UE) nr. 600/2014 ale Parlamentului European și ale Consiliului <sup>(2)</sup> se aplică de la 3 ianuarie 2018. Pentru a se asigura consecvența și securitatea juridică, prezentul regulament ar trebui să se aplice de la aceeași dată.
- (7) Prezentul regulament se bazează pe proiectul de standarde tehnice de punere în aplicare transmis Comisiei de către ESMA.
- (8) ESMA a efectuat consultări publice cu privire la proiectul de standarde tehnice de punere în aplicare pe care se bazează prezentul regulament, a analizat costurile și beneficiile potențiale aferente și a solicitat punctul de vedere al Grupului părților interesate din domeniul valorilor mobiliare și piețelor, instituit în conformitate cu articolul 37 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului <sup>(3)</sup>,

<sup>(1)</sup> JO L 173, 12.6.2014, p. 84.

<sup>(2)</sup> Regulamentul (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 (JO L 173, 12.6.2014, p. 84).

<sup>(3)</sup> Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/77/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 84).

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

*Articolul 1*

**Rapoartele săptămânale**

(1) Firmele de investiții sau operatorii de piață care exploatează un loc de tranzacționare elaborează raportul săptămânal prevăzut la articolul 58 alineatul (1) litera (a) din Directiva 2014/65/UE, separat pentru fiecare instrument financiar derivat pe mărfuri, certificat de emisii sau instrument financiar derivat pe acesta, tranzacționat în locul de tranzacționare respectiv, în conformitate cu formatul prevăzut în tabelele din anexa I la prezentul regulament.

(2) Raportul menționat la alineatul (1) prezintă valoarea agregată a tuturor pozițiilor deținute de persoane diferite în fiecare dintre categoriile prevăzute în tabelul 1 din anexa I, în fiecare instrument financiar derivat pe mărfuri, certificat de emisii sau instrument financiar derivat pe acesta, tranzacționat în locul de tranzacționare respectiv.

*Articolul 2*

**Rapoartele zilnice**

(1) Firmele de investiții transmit autorităților competente defalcarea pozițiilor lor conform articolului 58 alineatul (2) din Directiva 2014/65/UE prin intermediul unui raport zilnic al pozițiilor, în formatul din tabelele din anexa II la prezentul regulament.

(2) Raportul menționat la alineatul (1) prezintă toate pozițiile pentru toate maturitățile aferente tuturor contractelor.

*Articolul 3*

**Formatul de raportare**

Operatorii locurilor de tranzacționare și firmele de investiții transmit rapoartele menționate la articolele 1 și 2 în format standard XML obișnuit.

*Articolul 4*

**Intrarea în vigoare**

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Se aplică de la 3 ianuarie 2018.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în toate statele membre

Adoptat la Bruxelles, 20 iunie 2017.

Pentru Comisie  
Președintele  
Jean-Claude JUNCKER



Tabelul 2

Tabel al simbolurilor utilizate în tabelul 3

SIMBOL	TIP DE DATE	DEFINIȚIE
{ALPHANUM-n}	Până la n caractere alfanumerice	Câmp ce permite introducerea unui text liber.
{DECIMAL-n/m}	Număr zecimal de până la n cifre, din care până la m cifre pot fi cifre fracționare	Câmp numeric pentru valori atât pozitive, cât și negative: — separatorul zecimal este „.” (punct); — numerele negative încep cu semnul „-” (minus). Dacă este cazul, valorile sunt rotunjite și nu sunt trunchiate.
{DATEFORMAT}	Formatul datei ISO 8601	Datele sunt prezentate în următorul format: AAAA-LL-ZZ.
{DATE_TIME_FORMAT}	Formatul datei și orei ISO 8601	— Data și ora, în următorul format: AAAA-LL-ZZThh:mm:ss.ffffffZ. — „AAAA” reprezintă anul; — „LL” reprezintă luna; — „ZZ” reprezintă ziua; — „T” – înseamnă că trebuie utilizată litera „T”; — „hh” reprezintă ora; — „mm” reprezintă minutul; — „ss.ffffff” reprezintă secunda și fracțiunea de secundă; — Z reprezintă ora UTC (ora universală coordonată). Datele și orele se raportează în sistemul UTC.
{MIC}	4 caractere alfanumerice	Identificatorul pieței definit în ISO 10383
{INTEGER-n}	Număr întreg de până la n cifre în total	Câmp numeric pentru valori întregi atât pozitive, cât și negative.

Tabelul 3

Tabel cu câmpurile care trebuie raportate pentru fiecare instrument financiar derivat pe mărfuri, certificat de emisii sau instrument financiar derivat pe acesta, în sensul articolului 1

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Denumirea locului de tranzacționare	Câmpul se completează cu denumirea completă a locului de tranzacționare.	{ALPHANUM-350}
Identificatorul locului de tranzacționare	Câmpul se completează cu codul MIC de segment ISO 10383 al locului de tranzacționare. În cazul în care nu există un cod MIC de segment, se utilizează codul MIC operațional.	{MIC}

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Data la care se referă raportul săptămânal	Câmpul se completează cu data corespunzătoare zilei de vineri din săptămâna calendaristică în care este deținută poziția.	{DATEFORMAT}
Data și ora publicării	Câmpul se completează cu data și ora la care raportul este publicat pe site-ul locului de tranzacționare.	{DATE_TIME_FORMAT}
Denumirea contractului derivat pe mărfuri, a certificatului de emisii sau a instrumentului financiar derivat pe acesta	Câmpul se completează cu denumirea contractului derivat pe mărfuri, a certificatului de emisii sau a instrumentului financiar derivat pe acesta, identificată prin codul de produs alocat de către locul de tranzacționare.	{ALPHANUM-350}
Codul de produs alocat de locul de tranzacționare	Câmpul se completează cu identificatorul alfanumeric unic și univoc, utilizat de locul de tranzacționare, care grupează într-un singur produs contracte cu maturități și prețuri de exercitare diferite.	{ALPHANUM-12}
Statutul raportului	A se indica dacă raportul este nou ori anulează sau modifică un raport anterior. În cazul în care raportul transmis anterior este anulat sau modificat, ar trebui să se prezinte un raport care conține toate detaliile raportului inițial, iar la rubrica „Statutul raportului” ar trebui să se completeze „CANC”. În caz de modificare, ar trebui să se transmită un nou raport care conține toate detaliile raportului inițial și toate modificările necesare, iar la rubrica „Statutul raportului” ar trebui să se completeze „AMND”.	„NEWT” – Nou „CANC” – Anulare „AMND” – Modificare
Număr de poziții	Câmpul se completează cu cuantumul agregat al pozițiilor deschise deținute în ziua de vineri, la închiderea zilei de tranzacționare. Cuantumul ar trebui să fie exprimat fie în numărul de unități cantitative (atunci când limitele pozițiilor sunt exprimate în unități cantitative), fie în unități ale activului-suport. Contractele de opțiuni sunt incluse în agregare și raportate pe baza echivalentului delta.	{DECIMAL-15/2}
Simbol pentru cuantumul poziției	Câmpul se completează cu unitățile utilizate pentru raportarea numărului de poziții.	„LOTS” – în cazul în care cuantumul poziției este exprimat în unități cantitative sau {ALPHANUM-25} – descrierea unităților utilizate în cazul în care cuantumul poziției este exprimat în unități ale activului-suport
Variații față de raportul anterior (+/-)	Câmpul se completează cu cuantumul poziției care reflectă majorarea sau diminuarea poziției față de ziua de vineri anterioară. În cazul unei diminuări a poziției, cuantumul este exprimat sub forma unui număr negativ, precedat de semnul „-” (minus).	{DECIMAL-15/2}

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Procentaj din totalul pozițiilor deschise	Câmpul se completează cu procentajul pe care îl reprezintă pozițiile din totalul pozițiilor deschise.	{DECIMAL-5/2}
Numărul de persoane care dețin o poziție în fiecare categorie	Câmpul se completează cu numărul de persoane care dețin o poziție în categorie. Dacă numărul de persoane care dețin o poziție în categorie este sub numărul prevăzut de actul delegat al Comisiei care are temei articolul 58 alineatul (6) din MiFID II <sup>(1)</sup> , câmpul se completează cu „” (punct).	{INTEGER-7} sau {ALPHANUM-1} dacă se completează câmpul cu „” (punct).

<sup>(1)</sup> Regulamentul delegat (UE) 2017/565 al Comisiei din 25 aprilie 2016 de completare a Directivei 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului în ceea ce privește cerințele organizatorice și condițiile de funcționare aplicabile firmelor de investiții și termenii definiți în sensul directivei menționate (JO L 87, 31.3.2017, p. 1).

## ANEXA II

**Formatul pentru raportul zilnic**

Tabelul 1

**Tabel al simbolurilor utilizate în tabelul 2**

SIMBOL	TIP DE DATE	DEFINIȚIE
{ALPHANUM-n}	Până la n caractere alfanumerice	Câmp ce permite introducerea unui text liber.
{DECIMAL-n/m}	Număr zecimal de până la n cifre, din care până la m cifre pot fi cifre fracționare	Câmp numeric pentru valori atât pozitive, cât și negative: — separatorul zecimal este „.” (punct); — numerele negative încep cu semnul „-” (minus). Dacă este cazul, valorile sunt rotunjite și nu sunt trunchiate.
{DATEFORMAT}	Formatul datei ISO 8601	Datele sunt prezentate în următorul format: AAAA-LL-ZZ.
{DATE_TIME_FORMAT}	Formatul datei și orei ISO 8601	— Data și ora, în următorul format: AAAA-LL-ZZThh:mm:ss.ffffffZ. — „AAAA” reprezintă anul; — „LL” reprezintă luna; — „ZZ” reprezintă ziua; — „T” – înseamnă că trebuie utilizată litera „T”; — „hh” reprezintă ora; — „mm” reprezintă minutul; — „ss.ffffff” reprezintă secunda și fracțiunea de secundă; — Z reprezintă ora UTC (ora universală coordonată). Datele și orele se raportează în sistemul UTC.
{ISIN}	12 caractere alfanumerice	Codul ISIN definit în ISO 6166
{LEI}	20 de caractere alfanumerice	Identificatorul entității juridice definit în ISO 17442
{MIC}	4 caractere alfanumerice	Identificatorul pieței definit în ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 caractere alfanumerice	Identificatorul este cel prevăzut la articolul 6 din Regulamentul delegat 2017/590 al Comisiei <sup>(1)</sup> privind obligațiile de raportare a tranzacțiilor în conformitate cu articolul 26 din Regulamentul (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului <sup>(2)</sup> și Anexa II la regulamentul menționat.

SIMBOL	TIP DE DATE	DEFINIȚIE
{INTEGER-n}	Număr întreg de până la n cifre în total	Câmp numeric pentru valori întregi atât pozitive, cât și negative.

(1) Regulamentul delegat (UE) 2017/590 al Comisiei din 28 iulie 2016 de completare a Regulamentului (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului în ceea ce privește standardele tehnice de reglementare pentru raportarea tranzacțiilor către autoritățile competente (JO L 87, 31.3.2017, p. 449).

(2) Regulamentul (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 (JO L 173, 12.6.2014, p. 84).

Tabelul 2

**Tabel cu câmpurile în care se raportează toate pozițiile pentru toate maturitățile aferente tuturor contractelor, în sensul articolului 2**

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Data și ora transmiterii raportului	Câmpul se completează cu data și ora la care este transmis raportul.	{DATE_TIME_FORMAT}
Numărul de referință al raportului	Câmpul se completează cu identificatorul unic alocat de expeditor prin care raportul este identificat în mod univoc atât de expeditor, cât și de autoritatea competentă destinatară.	{ALPHANUM-52}
Data zilei de tranzacționare pentru poziția raportată	Câmpul se completează cu data la care este deținută poziția raportată la închiderea zilei de tranzacționare în locul de tranzacționare relevant.	{DATEFORMAT}
Statutul raportului	A se indica dacă raportul este nou ori anulează sau modifică un raport transmis anterior. În cazul în care raportul transmis anterior este anulat sau modificat, ar trebui să se transmită un raport care să conțină toate detaliile raportului original, inclusiv numărul de referință al acestuia, iar la rubrica „Statutul raportului” ar trebui să se completeze „CANC”. În caz de modificare, ar trebui să se transmită un nou raport care să conțină toate detaliile raportului original, inclusiv numărul de referință al acestuia și toate modificările necesare, iar la rubrica „Statutul raportului” ar trebui să se completeze „AMND”.	„NEWT” – Nou „CANC” – Anulare „AMND” – Modificare
Identificatorul entității raportoare	Identificatorul firmei de investiții raportoare. Câmpul se completează cu identificatorul entității juridice (cod LEI) pentru entitățile juridice sau cu {NATIONAL_ID} pentru persoanele fizice care nu au un cod LEI.	{LEI} sau {NATIONAL_ID} – Persoane fizice



CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Identificatorul deținătorului poziției	Câmpul se completează cu identificatorul entității juridice (cod LEI) pentru entitățile juridice sau cu {NATIONAL_ID} pentru persoanele fizice care nu au un cod LEI. (Notă: în cazul în care poziția este deținută ca poziție proprie a firmei raportoare, acest câmp este identic cu câmpul „Identificatorul entității raportoare”).	{LEI} sau {NATIONAL_ID} – Persoane fizice
Adresa de e-mail a deținătorului poziției	Adresa de e-mail pentru notificarea unor aspecte referitoare la poziție.	{ALPHANUM-256}
Identificatorul entității-mamă finale	Câmpul se completează cu identificatorul entității juridice (cod LEI) pentru entitățile juridice sau cu {NATIONAL_ID} pentru persoanele fizice care nu au un cod LEI. Notă: acest câmp poate fi identic cu câmpul „Identificatorul entității raportoare” sau „Identificatorul deținătorului poziției” în cazul în care entitatea-mamă finală efectuează propriile rapoarte sau deține propriile poziții.	{LEI} sau {NATIONAL_ID} – Persoane fizice
Adresa de e-mail a entității-mamă finale	Adresa de e-mail pentru corespondența referitoare la pozițiile agregate.	{ALPHANUM-256}
Statutul entității-mamă a organismului de plasament colectiv	Acest câmp este pentru raportare în cazul în care deținătorul poziției este un organism de plasament colectiv care adoptă decizii de investire independent de entitatea-mamă, conform articolului 4 alineatul (2) din Regulamentul delegat (UE) 2017/591 al Comisiei (1).	„ADEVĂRAT” – deținătorul poziției este un organism de plasament colectiv care adoptă decizii de investire în mod independent „FALS” – deținătorul poziției nu este un organism de plasament colectiv care adoptă decizii de investire în mod independent
Identificatorul contractelor tranzacționate în locul de tranzacționare	Identificatorul instrumentului financiar derivat pe mărfuri, al certificatului de emisii sau al instrumentului financiar derivat pe acesta. A se vedea câmpul „Identificatorul locului de tranzacționare” pentru regimul aplicat contractelor extrabursiere echivalente din punct de vedere economic cu contractele care sunt tranzacționate în locuri de tranzacționare.	{ISIN}
Codul de produs alocat de locul de tranzacționare	Câmpul se completează cu identificatorul alfanumeric unic și univoc utilizat de locul de tranzacționare care grupează într-un singur produs contracte cu maturități și prețuri de exercitare diferite.	{ALPHANUM-12}
Identificatorul locului de tranzacționare	Câmpul se completează cu codul MIC de segment ISO 10383 pentru pozițiile raportate aferente contractelor din locul de tranzacționare. În cazul în care nu există un cod MIC de segment, se utilizează codul MIC operațional.	{MIC}

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
	<p>A se utiliza codul MIC „XXXX” pentru pozițiile din afara locului de tranzacționare în contracte extrabursiere echivalente din punct de vedere economic.</p> <p>A se utiliza codul MIC „XOFF” pentru instrumentele financiare derivate cotate sau certificatele de emisii tranzacționate în afara burselor.</p>	
Tipul poziției	Câmp pentru raportare în cazul în care poziția este în futures, opțiuni, certificate de emisii sau instrumente financiare derivate pe acestea, instrumente financiare derivate pe mărfuri definite la articolul 4 alineatul (1) punctul 44 litera (c) din Directiva 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului (?) sau în alt tip de contract.	<p>„OPTN” – opțiuni, cu menționarea separată a opțiunilor tranzacționabile pe FUTR, SDRV sau tipuri OTHR și fără menționarea produselor pentru care opțiunea este doar un element încorporat</p> <p>„FUTR” – futures</p> <p>„EMIS” – certificate de emisii și instrumente financiare derivate pe acestea</p> <p>„SDRV” – instrumente financiare derivate pe mărfuri, definite la articolul 4 alineatul (1) punctul 44 litera (c) din Directiva 2014/65/UE</p> <p>„OTHR” – alte tipuri de contracte</p>
Maturitatea poziției	A se indica dacă maturitatea contractului care cuprinde poziția raportată este legată de luna <i>spot</i> sau de toate celelalte luni. Notă: sunt necesare rapoarte separate pentru lunile <i>spot</i> și pentru toate celelalte luni.	<p>„SPOT” – luna <i>spot</i>, inclusiv toate pozițiile în tipurile de poziții EMIS și SRDV</p> <p>„OTHR” – toate celelalte luni</p>
Cuantumul poziției	<p>Câmpul se completează cu cuantumul net al poziției deținute în instrumente financiare derivate pe mărfuri, certificate de emisii sau instrumente financiare derivate pe acestea exprimat fie în unități cantitative, în cazul în care limitele poziției sunt exprimate în unități cantitative, fie în unități ale activului-suport.</p> <p>Câmpul ar trebui să se completeze cu un număr pozitiv pentru pozițiile lungi și cu un număr negativ pentru pozițiile scurte.</p> <p>În cazul în care poziția este în instrumente financiare derivate pe mărfuri definite la articolul 4 alineatul (1) punctul 44 litera (c) din Directiva 2014/65/UE, câmpul se completează cu numărul de unități deținute.</p>	{DECIMAL-15/2}
Simbol pentru cuantumul poziției	Câmpul se completează cu unitățile utilizate pentru raportarea cuantumului poziției.	<p>„LOTS” – în cazul în care cuantumul poziției este exprimat în unități cantitative</p> <p>{ALPHANUM-25} – descrierea unităților utilizate în cazul în care cuantumul poziției este exprimat în unități ale activului-suport</p> <p>„UNIT” – în cazul în care cuantumul poziției este exprimat în unități</p>

CÂMP	DETALII DE RAPORTAT	FORMAT PENTRU RAPORTARE
Echivalentul delta al cuantumului poziției	În cazul în care tipul poziției este „OPTN” sau o opțiune pe „EMIS”, câmpul se completează cu echivalentul delta al cuantumului poziției raportat în câmpul „Cuantumul poziției”. Câmpul ar trebui să se completeze cu un număr pozitiv pentru opțiunile call cu poziție lungă și pentru opțiunile put cu poziție scurtă și cu un număr negativ pentru opțiunile call cu poziție scurtă și pentru opțiunile put cu poziție lungă.	{DECIMAL-15/2}
A se indica dacă poziția reduce riscurile legate de activitatea comercială	Câmp pentru raportare în cazul în care poziția reduce riscurile în conformitate cu articolul 7 din Regulamentul delegat (UE) 2017/591.	„ADEVĂRAT” – poziția reduce riscurile „FALS” – poziția nu reduce riscurile

(1) Regulamentul delegat (UE) 2017/591 al Comisiei din 1 decembrie 2016 de completare a Directivei 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului cu privire la standardele tehnice de reglementare pentru aplicarea de limite ale pozițiilor în cazul instrumentelor financiare derivate pe mărfuri (JO L 87, 31.3.2017, p. 479).

(2) Directiva 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare și de modificare a Directivei 2002/92/CE și a Directivei 2011/61/UE (JO L 173, 12.6.2014, p. 349).