

UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2017/1093 VAN DE COMMISSIE**van 20 juni 2017****tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot het formaat van positierapporten van beleggingsondernemingen en marktexploitanten****(Voor de EER relevante tekst)**

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 ⁽¹⁾ betreffende markten voor financiële instrumenten, en met name artikel 58, lid 5, daarvan,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) In het wekelijks rapport met de geaggregeerde posities die worden aangehouden door verschillende categorieën personen voor de verschillende grondstoffenderivaten of emissierechten of derivaten daarvan die op handelsplatformen worden verhandeld, moeten de posities worden uitgesplitst in posities die op objectief meetbare wijze de risico's verminderen die rechtstreeks verband houden met commerciële activiteiten, andere en totale posities om transparantie te verschaffen over de splitsing tussen financiële en niet-financiële activiteiten bij dergelijke grondstoffenderivaten, emissierechten of derivaten daarvan.
- (2) De dagelijkse rapporten met een volledige uitsplitsing van de posities in grondstoffenderivaten of emissierechten of derivaten daarvan die op handelsplatformen worden verhandeld en economisch gelijkwaardige over-the-counter (OTC)-contracten van beleggingsondernemingen en hun cliënten moeten zo worden gestructureerd dat toezicht op en toepassing van de positielimieten krachtens artikel 57 van Richtlijn 2014/65/EU mogelijk is.
- (3) Posities uit hoofde van de spread van koop- en verkooptransacties tussen verschillende leveringsdatums of grondstoffen of uit hoofde van andere complexe strategieën moeten op een gedesaggregeerde basis worden gerapporteerd tenzij de combinatie van producten wordt verhandeld als één enkel financieel instrument dat aan de hand van een ISIN is geïdentificeerd en de daarin aangehouden posities aan een specifieke limiet onderworpen zijn.
- (4) Om hun taken effectief en consistent uit te voeren, moeten de gegevens van beleggingsondernemingen en marktexploitanten die een handelsplatform exploiteren welke de relevante autoriteiten van hen ontvangen met elkaar te vergelijken zijn. Het gebruik van een gemeenschappelijk formaat door alle verschillende financiële marktinfrastructuren vergemakkelijkt het gebruik op grotere schaal door een grote verscheidenheid van marktdeelnemers en is daardoor bevorderlijk voor standaardisatie.
- (5) Om ononderbroken verwerking en kostenvermindering voor marktdeelnemers te vergemakkelijken, moeten beleggingsondernemingen en marktexploitanten die een handelsplatform exploiteren standaardformaten gebruiken.
- (6) De nieuwe wetgeving van het Europees Parlement en de Raad betreffende markten voor financiële instrumenten beschreven in Richtlijn 2014/65/EU en Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ⁽²⁾ is van toepassing met ingang van 3 januari 2018. Omwille van de samenhang en de rechtszekerheid moet deze verordening vanaf dezelfde datum van toepassing zijn.
- (7) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen die de ESMA aan de Commissie heeft voorgelegd.
- (8) De ESMA heeft open publieke raadplegingen gehouden over de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, heeft de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd en heeft de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht ⁽³⁾,

⁽¹⁾ PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84.

⁽²⁾ Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84).

⁽³⁾ Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Wekelijkse rapporten

1. Beleggingsondernemingen of marktexploitanten die een handelsplatform exploiteren, stellen het wekelijks rapport als bedoeld in artikel 58, lid 1, onder a), van Richtlijn 2014/65/EU afzonderlijk op voor elk grondstoffenderivaat, emissierecht of derivaat daarvan dat op dat handelsplatform wordt verhandeld, overeenkomstig het formaat beschreven in de tabellen van bijlage I bij deze verordening.
2. De in lid 1 bedoelde rapporten bevatten het aggregaat van alle posities die worden aangehouden door de verschillende personen in elk van de categorieën beschreven in tabel 1 van bijlage I in een afzonderlijk grondstoffenderivaat, emissierecht of derivaat daarvan dat op dat handelsplatform wordt verhandeld.

Artikel 2

Dagelijkse rapporten

1. Beleggingsondernemingen verstrekken de bevoegde autoriteiten de uitsplitsing van hun posities als bedoeld in artikel 58, lid 2, van Richtlijn 2014/65/EU door middel van een dagelijks positierapport in het formaat beschreven in de tabellen van bijlage II bij deze verordening.
2. Het in lid 1 bedoeld rapport bevat alle posities voor alle looptijden van alle contracten.

Artikel 3

Rapportageformaat

Exploitanten van handelsplatformen en beleggingsondernemingen dienen de rapporten als bedoeld in de artikelen 1 en 2 in een gemeenschappelijk standaard XML-formaat in.

Artikel 4

Inwerkingtreding

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Zij is van toepassing met ingang van 3 januari 2018.

Deze verordening is bindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 20 juni 2017.

Voor de Commissie
De voorzitter
Jean-Claude JUNCKER

Tabel 2

Tabel van symbolen voor tabel 3

SYMBOOL	TYPE GEGEVENS	DEFINITIE
{ALPHANUM-n}	Maximaal n alfanumerieke tekens	Veld voor vrije tekst.
{DECIMAL-n/m}	Decimaal getal van maximaal n cijfers in totaal, waarvan maximaal m cijfers fractiecijfers kunnen zijn.	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve waarden: — het decimaalteken is „.” (punt); — negatieve getallen worden voorafgegaan door „-” (min). Indien nodig worden waarden afgerond, niet afgebroken.
{DATEFORMAT}	Datumformaat volgens ISO 8601	Datums worden weergegeven in het volgende formaat: JJJJ-MM-DD.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datum- en tijdformaat volgens ISO 8601	— Datum en tijd in het volgende formaat: JJJJ-MM-DDTuu:mm:ss.dddddZ. — „JJJJ” is het jaar; — „MM” is de maand; — „DD” is de dag; — „T” — betekent dat de letter „T” wordt gebruikt; — „uu” is het uur; — „mm” is de minuut; — „ss.ddddd” is de seconde en de fractie van een seconde; — Z is de UTC-tijd. Datums en tijden moeten worden uitgedrukt in UTC.
{MIC}	4 alfanumerieke tekens	Marktidentificatiecode volgens ISO 10383.
{INTEGER-n}	Geheel getal van maximaal n tekens in totaal	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve gehele waarden.

Tabel 3

Tabel van voor elk grondstoffenderivaat, emissierecht of derivaat voor de toepassing van artikel 1 te rapporteren velden

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
Naam van het handelsplatform	In het veld de volledige naam van het handelsplatform invullen.	{ALPHANUM-350}
Identificatiecode van het handelsplatform	In het veld de segment-MIC volgens ISO 10383 van het handelsplatform invullen Indien de segment-MIC niet bestaat, de exploitant-MIC gebruiken.	{MIC}

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
Datum waarop het wekelijks rapport betrekking heeft	In het veld de datum invullen die overeenstemt met de vrijdag van de kalenderweek waarop de positie wordt aangehouden.	{DATEFORMAT}
Datum en tijd van publicatie	In het veld de datum en tijd invullen waarop het rapport op de website van het handelsplatform wordt gepubliceerd.	{DATE_TIME_FORMAT}
Naam van het grondstoffenderivatatencontract, emissierecht of derivaat daarvan	In dit veld de naam invullen van het grondstoffenderivatatencontract, emissierecht of derivaat daarvan geïdentificeerd aan de hand van de productcode van het platform.	{ALPHANUM-350}
Productcode van het platform	In het veld een unieke en eenduidige alfanumerieke identificatiecode die door het handelsplatform wordt gebruikt invullen, waarbij contracten met een verschillende looptijd en uitoefenprijs bij hetzelfde product worden ondergebracht.	{ALPHANUM-12}
Rapportstatus	Vermelding of het rapport nieuw is dan wel of een vorig rapport wordt geannuleerd of gewijzigd. Indien een vroeger ingediend rapport wordt geannuleerd of gewijzigd, moet een rapport dat alle informatie van het oorspronkelijke rapport bevat worden ingediend en moet de „Rapportstatus” als „CANC” worden gemarkeerd. Voor wijzigingen moet een nieuw rapport dat alle informatie van het oorspronkelijke rapport bevat met alle gewijzigde noodzakelijke informatie worden ingediend en moet de „Rapportstatus” als „AMND” worden gemarkeerd.	„NEWT” — Nieuw „CANC” — Annulering „AMND” — Wijziging
Aantal posities	In het veld de geaggregeerde kwantiteit openstaande posities invullen die op vrijdag aan het einde van de handelsdag worden aangehouden. De kwantiteit moet worden uitgedrukt in het aantal series (wanneer de positielimiten in series worden uitgedrukt) of eenheden van het onderliggende. Optiecontracten worden in de aggregatie opgenomen en op delta-equivalente basis gerapporteerd.	{DECIMAL-15/2}
Vermelding van de positiekwantiteit	In het veld worden de eenheden ingevuld die gebruikt worden om het aantal posities te rapporteren.	„LOTS” — als de positiekwantiteit wordt uitgedrukt in series of {ALPHANUM-25} — een beschrijving van de gebruikte eenheden als de positiekwantiteit wordt uitgedrukt in eenheden van het onderliggende
Wijzigingen sinds het vorige rapport (+/-)	In het veld de positiekwantiteit invullen die de stijging of daling in de positie ten opzichte van de vrijdag daarvoor weergeeft. In geval van een daling in de positie wordt het getal uitgedrukt als een negatief getal voorafgegaan door „-” (min).	{DECIMAL-15/2}

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
Percentage totale openstaande posities	In het veld het percentage van de totale openstaande posities invullen dat door de posities wordt gevormd.	{DECIMAL-5/2}
Aantal personen dat een positie aanhoudt in elke categorie	In het veld het aantal personen invullen dat een positie aanhoudt in de categorie. Als het aantal personen dat een positie aanhoudt in de categorie onder het aantal ligt dat in de gedelegeerde verordening van de Commissie met betrekking tot artikel 58, lid 6, MiFID II ⁽¹⁾ wordt gespecificeerd, in het veld „” invullen.	{INTEGER-7} of {ALPHANUM-1} als in het veld „” (punt) moet worden ingevuld.

⁽¹⁾ Gedelegeerde Verordening (EU) nr. 2017/565 van de Commissie van 25 april 2016 houdende aanvulling van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad wat betreft de door beleggingsondernemingen in acht te nemen organisatorische eisen en voorwaarden voor de bedrijfsuitoefening en wat betreft de definitie van begrippen voor de toepassing van genoemde richtlijn (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 1).

BIJLAGE II

Formaat voor dagelijkse rapporten

Tabel 1

Tabel van symbolen voor tabel 2

SYMBOOL	TYPE GEGEVENS	DEFINITIE
{ALPHANUM-n}	Maximaal n alfanumerieke tekens	Veld voor vrije tekst.
{DECIMAL-n/m}	Decimaal getal van maximaal n cijfers in totaal, waarvan maximaal m cijfers fractiecijfers kunnen zijn.	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve waarden: — het decimaalteken is „.” (punt); — negatieve getallen worden voorafgegaan door „-” (min). Indien nodig worden waarden afgerond, niet afgebroken.
{DATEFORMAT}	Datumformaat volgens ISO 8601	Datums worden weergegeven in het volgende formaat: JJJJ-MM-DD.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datum- en tijdformaat volgens ISO 8601	— Datum en tijd in het volgende formaat: JJJJ-MM-DDTuu:mm:ss.dddZ. — „JJJJ” is het jaar; — „MM” is de maand; — „DD” is de dag; — „T” — betekent dat de letter „T” wordt gebruikt; — „uu” is het uur; — „mm” is de minuut; — „ss.dddZ” is de seconde en de fractie van een seconde; — Z is de UTC-tijd. Datums en tijden moeten worden uitgedrukt in UTC.
{ISIN}	12 alfanumerieke tekens	ISIN-code volgens ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerieke tekens	Identificatiecode juridische entiteit volgens ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerieke tekens	Marktidentificatiecode volgens ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alfanumerieke tekens	De ID wordt beschreven in artikel 6 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 ⁽¹⁾ van de Commissie inzake verplichtingen om transacties te melden overeenkomstig artikel 26 van Verordening (EU) nr. 600/2014 ⁽²⁾ van het Europees Parlement en de Raad en BIJLAGE II bij die verordening.

SYMBOOL	TYPE GEGEVENS	DEFINITIE
{INTEGER-n}	Geheel getal van maximaal n tekens in totaal	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve gehele waarden.

- (¹) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie van 28 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ten aanzien van technische reguleringsnormen voor het melden van transacties aan de bevoegde autoriteiten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 449).
- (²) Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84).

Tabel 2

Tabel van voor elk grondstoffenderivaat, emissierecht of derivaat voor de toepassing van artikel 2 te rapporteren velden

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
Datum en tijd van indiening rapport	In het veld de datum en de tijd invullen waarop het rapport wordt ingediend.	{DATE_TIME_FORMAT}
Referentienummer van het rapport	In het veld de door de indiener gegeven unieke identificatiecode invullen waarmee het rapport m.b.t. zowel de indiener als de ontvangende bevoegde autoriteit ondubbelzinnig wordt geïdentificeerd.	{ALPHANUM-52}
Datum van de handelsdag van de gerapporteerde positie	In het veld de datum invullen waarop de gerapporteerde positie aan het einde van de handelsdag op het desbetreffende handelsplatform wordt aangehouden.	{DATEFORMAT}
Rapportstatus	Vermelding of het rapport nieuw is dan wel of een vroeger ingediend rapport wordt geannuleerd of gewijzigd. Indien een vroeger ingediend rapport wordt geannuleerd of gewijzigd, moet een rapport dat alle informatie van het oorspronkelijke rapport bevat onder gebruikmaking van het oorspronkelijke referentienummer van het rapport worden ingediend en moet de „Rapportstatus” als „CANC” worden gemarkeerd. Voor wijzigingen moet een nieuw rapport dat alle informatie van het oorspronkelijke rapport bevat onder gebruikmaking van het oorspronkelijke referentienummer van het rapport met alle gewijzigde noodzakelijke informatie worden ingediend en moet de „Rapportstatus” als „AMND” worden gemarkeerd.	„NEWT” — Nieuw „CANC” — Annulering „AMND” — Wijziging
ID van de rapporterende entiteit	De identificatiecode van de rapporterende beleggingsonderneming. In het veld voor juridische entiteiten de identificatiecode juridische entiteit (LEI) of voor natuurlijke personen die niet over een LEI beschikken {NATIONAL_ID} invullen.	{LEI} of {NATIONAL_ID} — Natuurlijke personen

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
ID van de positiehouder	In het veld voor juridische entiteiten de identificatiecode juridische entiteit (LEI) of voor natuurlijke personen die niet over een LEI beschikken {NATIONAL_ID} invullen. (Noot: als de positie wordt aangehouden als een eigen positie van de rapporterende onderneming, is dit veld identiek aan het veld „ID van de rapporterende entiteit”).	{LEI} of {NATIONAL_ID} — Natuurlijke personen
E-mailadres van de positiehouder	E-mailadres voor kennisgevingen van positiegerelateerde aangelegenheden.	{ALPHANUM-256}
ID uiteindelijkkemoederentiteit	In het veld voor juridische entiteiten de identificatiecode juridische entiteit (LEI) of voor natuurlijke personen die niet over een LEI beschikken {NATIONAL_ID} invullen. Opmerking: dit veld kan identiek zijn aan het veld „ID van de rapporterende entiteit” of „ID van de positiehouder” als de uiteindelijkkemoederentiteit haar eigen posities aanhoudt of haar eigen rapporten opstelt.	{LEI} of {NATIONAL_ID} — Natuurlijke personen
E-mailadres van de uiteindelijkkemoederentiteit	E-mailadres voor correspondentie met betrekking tot geaggregeerde posities.	{ALPHANUM-256}
Status ten opzichte van de moederonderneming van een collectieve beleggingsregeling	In het veld rapporteren of de positiehouder een instelling voor collectieve belegging is die onafhankelijk van haar moedermaatschappij beleggingsbeslissingen neemt zoals beschreven in artikel 4, lid 2, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/591 van de Commissie (!).	„TRUE” — de positiehouder is een instelling voor collectieve belegging die onafhankelijke beleggingsbeslissingen neemt „FALSE” — de positiehouder is geen instelling voor collectieve belegging die onafhankelijke beleggingsbeslissingen neemt
Identificatiecode van het op handelsplatformen verhandeld contract	Identificatiecode van het grondstoffenderivaat, emissierecht of een derivaat daarvan. Zie veld „Identificatiecode van het handelsplatform” voor de behandeling van OTC-contracten die economisch gelijkwaardig zijn aan contracten die op handelsplatforms worden verhandeld.	{ISIN}
Productcode van het platform	In het veld een unieke en eenduidige alfanumerieke identificatiecode die door het handelsplatform wordt gebruikt invullen, waarbij contracten met een verschillende looptijd en uitoefenprijs bij hetzelfde product worden ondergebracht.	{ALPHANUM-12}
Identificatiecode van handelsplatform	In het veld de segment-MIC volgens ISO 10383 invullen voor posities gerapporteerd met betrekking tot op handelsplatformen verhandelde contracten. Indien de segment-MIC niet bestaat, de exploitant-MIC gebruiken.	{MIC}

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
	<p>De MIC-code „XXXX” gebruiken voor posities buiten een handelsplatform in economisch gelijkwaardige OTC-contracten.</p> <p>MIC-code „XOFF” gebruiken voor beursgenoteerde derivaten of emissierechten die buiten de beurs worden verhandeld.</p>	
Type positie	<p>Veld om te rapporteren of het gaat om een positie in futures, opties, emissierechten of derivaten daarvan, grondstoffenderivaten gedefinieerd in artikel 4, lid 1, punt 44, onder c), van Richtlijn 2014/65/EU⁽²⁾ van het Europees Parlement en de Raad of een ander type van contract.</p>	<p>„OPTN” — Opties, inclusief afzonderlijk verhandelbare opties op de types FUTR, SDRV of OTHR, met uitzondering van producten waarbij het alleen om een embedded optie gaat</p> <p>„FUTR” — Futures</p> <p>„EMIS” — Emissierechten en derivaten daarvan</p> <p>„SDRV”: Grondstoffenderivaten gedefinieerd in artikel 4, lid 1, punt 44, onder c), van Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>„OTHR” — alle andere contracttypen</p>
Positielooptijd	<p>Vermelding of de looptijd van het contract dat de gerapporteerde positie omvat op de spot month of op alle andere maanden betrekking heeft. Opmerking: er zijn afzonderlijke verslagen vereist voor spot months en alle andere maanden.</p>	<p>„SPOT” — spot month, inclusief alle posities in de positietyperen EMIS en SRDV</p> <p>„OTHR” — alle andere maanden</p>
Positiekwantiteit	<p>In het veld de nettopositiekwantiteit invullen die wordt aangehouden in het grondstoffenderivaat, de emissierechten of derivaten daarvan uitgedrukt in series, wanneer de positielimieten in series worden uitgedrukt, of eenheden van het onderliggende.</p> <p>In dit veld een positief getal invullen voor longposities en een negatief getal voor shortposities.</p> <p>Als het om een positie in grondstoffenderivaten gaat als gedefinieerd in artikel 4, lid 1, punt 44, onder c), van Richtlijn 2014/65/EU moet in dit veld het aantal aangehouden eenheden worden ingevuld.</p>	{DECIMAL-15/2}
Vermelding van de positiekwantiteit	<p>In het veld worden de eenheden ingevuld die gebruikt worden om de positiekwantiteit te rapporteren.</p>	<p>„LOTS” — als de positiekwantiteit wordt uitgedrukt in series</p> <p>{ALPHANUM-25} — een beschrijving van de gebruikte eenheden als de positiekwantiteit wordt uitgedrukt in eenheden van het onderliggende</p> <p>„UNIT” — als de positiekwantiteit wordt uitgedrukt in eenheden</p>

VELD	TE RAPPORTEREN INFORMATIE	RAPPORTAGEFORMAAT
Delta-equivalente positiekwantiteit	Als het positietype „OPTN” of een optie op „EMIS” is, moet in dit veld de delta-equivalente kwantiteit van de in het veld „Positiekwantiteit” gerapporteerde positie worden ingevuld. In dit veld een positief getal voor longcalls en shortputs en een negatief getal voor longputs en shortcalls invullen.	{DECIMAL-15/2}
Indicatie of de positie het risico vermindert in verband met commerciële activiteiten	Veld om te rapporteren of de positie risicoverminderend is overeenkomstig artikel 7 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/591.	„TRUE” — de positie is risicoverminderend „FALSE” — de positie is niet risicoverminderend

(¹) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/591 van de Commissie van 1 december 2016 tot aanvulling van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor de toepassing van positielimiets op grondstoffenderivaten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 479).

(²) Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten voor financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 349).