

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Ι

Πίνακας 1
Κατάλογος πεδίων για τις γνωστοποιήσεις

Τίτλος	Περιγραφή
1. Στοιχείο αναγνώρισης γνωστοποιούσας επιχείρησης	Ο μοναδικός κωδικός με τον οποίο αναγνωρίζεται η εταιρεία που εκτέλεσε τη συναλλαγή
2. Ημέρα διαπραγμάτευσης	Η ημέρα διαπραγμάτευσης κατά την οποία εκτελέστηκε η συναλλαγή
3. Ώρα διαπραγμάτευσης	Η ώρα κατά την οποία εκτελέστηκε η συναλλαγή, στην τοπική ώρα της αρμόδιας αρχής στην οποία θα γνωστοποιηθεί η συναλλαγή, και η βάση στην οποία γνωστοποιείται η συναλλαγή εκφρασμένη σε συντονισμένη παγκόσμια ώρα (UTC) +/- ώρες
4. Ένδειξη αγοράς/πώλησης	Διευκρινίζει αν η συναλλαγή ήταν αγορά ή πώληση από τη σκοπιά της γνωστοποιούσας επιχείρησης επενδύσεων ή, αν η γνωστοποίηση γίνεται προς πελάτη, από τη σκοπιά του πελάτη
5. Ιδιότητα διαπραγματευτή	Διευκρινίζει αν η επιχείρηση εκτέλεσε τη συναλλαγή — για δικό της λογαριασμό (είτε εξ ονόματος της ίδιας είτε εξ ονόματος πελάτη), — για λογαριασμό και εξ ονόματος πελάτη
6. Στοιχείο αναγνώρισης μέσου	Το πεδίο αυτό περιλαμβάνει: — τον μοναδικό κωδικό (αν υπάρχει) τον οποίο καθορίζει η αρμόδια αρχή στην οποία υποβάλλεται η γνωστοποίηση, με προσδιορισμό του χρηματοπιστωτικού μέσου που είναι αντικείμενο της συναλλαγής, — αν το σχετικό χρηματοπιστωτικό μέσο δεν διαθέτει μοναδικό κωδικό αναγνώρισης, η γνωστοποίηση πρέπει να περιλαμβάνει την ονομασία του μέσου ή, σε περίπτωση σύμβασης παραγωγού, τα χαρακτηριστικά της σύμβασης
7. Τύπος κωδικού μέσου	Ο τύπος κωδικού που χρησιμοποιείται για τη γνωστοποίηση του μέσου
8. Στοιχείο αναγνώρισης υποκείμενου μέσου	Στοιχείο αναγνώρισης που εφαρμόζεται στον τίτλο που αποτελεί το υποκείμενο περιουσιακό στοιχείο σε σύμβαση παραγωγού, καθώς και η κινητή αξία που εμπίπτει στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 18 στοιχείο γ) της οδηγίας 2004/39/ΕΚ
9. Τύπος κωδικού αναγνώρισης υποκείμενου μέσου	Ο τύπος κωδικού που χρησιμοποιείται για τη γνωστοποίηση του υποκείμενου μέσου
10. Είδος μέσου	Εναρμονισμένη ταξινόμηση του χρηματοπιστωτικού μέσου που αποτελεί αντικείμενο της συναλλαγής. Η περιγραφή πρέπει να αναφέρει τουλάχιστον αν το μέσο εμπίπτει σε μία από τις υψηλού επιπέδου κατηγορίες ενός ομοιόμορφου διεθνώς αποδεκτού προτύπου ταξινόμησης των χρηματοπιστωτικών μέσων
11. Ημερομηνία λήξης	Η ημερομηνία λήξης ομολόγου ή άλλης μορφής τιτλοποιημένου χρέους ή η ημερομηνία άσκησης/λήξης σύμβασης παραγωγού
12. Είδος παραγωγού	Η εναρμονισμένη περιγραφή του είδους του παραγωγού μέσου πρέπει να γίνεται σύμφωνα με μία από τις υψηλού επιπέδου κατηγορίες ενός ομοιόμορφου διεθνώς αποδεκτού προτύπου ταξινόμησης των χρηματοπιστωτικών μέσων
13. Δικαίωμα πώλησης ή αγοράς (Put/Call)	Διευκρίνιση αν ένα δικαίωμα προαίρεσης ή οποιοδήποτε άλλο χρηματοπιστωτικό μέσο είναι δικαίωμα πώλησης ή αγοράς
14. Τιμή άσκησης	Η τιμή άσκησης ενός δικαιώματος προαίρεσης ή άλλου χρηματοπιστωτικού μέσου
15. Πολλαπλασιαστής τιμής	Αριθμός μονάδων του σχετικού χρηματοπιστωτικού μέσου που περιέχεται σε μία μονάδα διαπραγμάτευσης· για παράδειγμα, ο αριθμός παραγώγων ή τίτλων που αντιπροσωπεύει μία σύμβαση
16. Τιμή μονάδας	Η τιμή ανά κινητή αξία ή ανά σύμβαση παραγωγού μη περιλαμβανομένης της προμήθειας και (κατά περίπτωση) των δεδουλευμένων τόκων. Σε περίπτωση χρεωστικού τίτλου, η τιμή μπορεί να εκφράζεται είτε σε νόμισμα είτε σε ποσοστό

Τίτλος	Περιγραφή
17. Ένδειξη συμβόλου τιμής	Το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται η τιμή. Αν, σε περίπτωση ομολόγου ή άλλου τιτλοποιημένου χρέους, η τιμή εκφράζεται σε ποσοστό, περιλαμβάνεται το σχετικό ποσοστό
18. Ποσότητα	Αριθμός μονάδων του χρηματοπιστωτικού μέσου, ονομαστική αξία των ομολόγων, ή αριθμός συμβάσεων παραγωγού που περιλαμβάνονται στη συναλλαγή
19. Ένδειξη συμβόλου ποσότητας	Αναφέρεται αν η ποσότητα είναι ο αριθμός των μονάδων των χρηματοπιστωτικών μέσων, η ονομαστική αξία των ομολόγων ή ο αριθμός των συμβάσεων παραγωγού
20. Αντισυμβαλλόμενος	Στοιχείο αναγνώρισης του αντισυμβαλλόμενου στη συναλλαγή. Το στοιχείο αναγνώρισης είναι: <ul style="list-style-type: none"> — αν ο αντισυμβαλλόμενος είναι επιχείρηση επενδύσεων, ο μοναδικός κωδικός (αν υπάρχει) για τη σχετική επιχείρηση, τον οποίο καθορίζει η αρμόδια αρχή στην οποία υποβάλλεται η γνωστοποίηση, — αν ο αντισυμβαλλόμενος είναι ρυθμιζόμενη αγορά ή ΠΜΔ ή οντότητα που ενεργεί ως κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, ο μοναδικός εναρμονισμένος κωδικός αναγνώρισης για την εν λόγω αγορά, τον ΠΜΔ ή την οντότητα που ενεργεί ως κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, όπως αναφέρεται στον κατάλογο που δημοσιεύεται από την αρμόδια αρχή του κράτους μέλους καταγωγής της σχετικής οντότητας σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 2, — αν ο αντισυμβαλλόμενος δεν είναι επιχείρηση επενδύσεων, ρυθμιζόμενη αγορά, ΠΜΔ ή οντότητα που ενεργεί ως κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, πρέπει να αναγνωρίζεται ως «πελάτης» της επιχείρησης επενδύσεων που εκτέλεσε τη συναλλαγή
21. Στοιχείο αναγνώρισης	Στοιχείο αναγνώρισης του τόπου όπου εκτελέστηκε η συναλλαγή. Το στοιχείο αναγνώρισης είναι: <ul style="list-style-type: none"> — αν ο κρίσιμος τόπος είναι τόπος διαπραγμάτευσης: ο μοναδικός εναρμονισμένος κωδικός αναγνώρισης, — σε κάθε άλλη περίπτωση: ο κωδικός «OTC»
22. Αριθμός αναφοράς της συναλλαγής	Μοναδικός αριθμός αναγνώρισης για τη συναλλαγή, ο οποίος παρέχεται από την επιχείρηση επενδύσεων ή από τρίτο που γνωστοποιεί εκ μέρους της
23. Σήμα ακύρωσης	Ένδειξη ότι η συναλλαγή ακυρώθηκε

Πίνακας 2

Περαιτέρω πληροφοριακά στοιχεία για χρήση από τις αρμόδιες αρχές

Τίτλος	Περιγραφή
1. Στοιχείο αναγνώρισης γνωστοποιούσας επιχείρησης	Εάν ο μοναδικός κωδικός που αναφέρεται στον πίνακα 1 του παραρτήματος I δεν αρκεί για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου, οι αρμόδιες αρχές πρέπει να λάβουν κατάλληλα μέτρα ώστε να διασφαλίζεται η αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου
6. Στοιχείο αναγνώρισης μέσου	Χρησιμοποιείται ο μοναδικός κωδικός, όπως συμφωνήθηκε μεταξύ όλων των αρμόδιων αρχών, που εφαρμόζεται στο σχετικό χρηματοπιστωτικό μέσο
20. Αντισυμβαλλόμενος	Εάν ο μοναδικός κωδικός ή ο μοναδικός εναρμονισμένος κωδικός αναγνώρισης που αναφέρεται στον πίνακα 1 του παραρτήματος I δεν αρκεί για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου, οι αρμόδιες αρχές πρέπει να λάβουν κατάλληλα μέτρα ώστε να διασφαλίζεται η αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ II

Πίνακας 1

Πληροφορίες που πρέπει να δημοσιοποιούνται σύμφωνα με το άρθρο 17

Είδος συστήματος	Περιγραφή του συστήματος	Περίληψη των πληροφοριών που πρέπει να δημοσιοποιούνται σύμφωνα με το άρθρο 17
Σύστημα συνεχούς διαπραγμάτευσης βάσει βιβλίου εντολών	Σύστημα το οποίο, μέσω βιβλίου εντολών και αλγορίθμου διαπραγμάτευσης που λειτουργεί χωρίς ανθρώπινη παρέμβαση, αντιστοιχίζει τις εντολές πώλησης με αντίστοιχες εντολές αγοράς βάσει της καλύτερης διαθέσιμης τιμής σε συνεχή βάση	Το άρθροισμα του αριθμού των εντολών, καθώς και των μετοχών που αυτές αντιπροσωπεύουν σε κάθε επίπεδο τιμής, τουλάχιστον για τα πέντε καλύτερα επίπεδα τιμών αγοράς και πώλησης
Σύστημα διαπραγμάτευσης βάσει ζευγών εντολών	Σύστημα στο οποίο οι συναλλαγές συνάπτονται με βάση δεσμευτικά ζεύγη εντολών που τίθενται σε συνεχή βάση στη διάθεση των συμμετεχόντων, και το οποίο υποχρεώνει τους ειδικούς διαπραγματευτές να διατηρούν ζεύγη εντολών σε μέγεθος που εξισορροπεί την ανάγκη των μελών και των συμμετεχόντων να διαπραγματεύονται σε εμπορικά μεγέθη με τον κίνδυνο στον οποίον εκτίθεται ο ειδικός διαπραγματευτής	Η καλύτερη κοινοποιούμενη τιμή αγοράς και πώλησης για κάθε ειδικό διαπραγματευτή της σχετικής μετοχής, καθώς και οι όγκοι που συνδέονται με τις τιμές αυτές
Σύστημα διαπραγμάτευσης με περιοδική δημοπρασία	Σύστημα το οποίο αντιστοιχίζει εντολές με περιοδική δημοπρασία και αλγόριθμο διαπραγμάτευσης που λειτουργεί χωρίς ανθρώπινη παρέμβαση	Η τιμή στην οποία το σύστημα διαπραγμάτευσης με δημοπρασία ικανοποιεί με τον καλύτερο τρόπο τον αλγόριθμο διαπραγμάτευσης και ο όγκος που θα μπορούσε δυνητικά να εκτελεστεί στην τιμή αυτή
Σύστημα διαπραγμάτευσης που δεν εμπίπτει στις πρώτες τρεις σειρές	Υβριδικό σύστημα που εμπίπτει σε τουλάχιστον δύο από τις πρώτες τρεις σειρές ή σύστημα στο οποίο η διαδικασία προσδιορισμού της τιμής είναι διαφορετικής φύσεως από εκείνη που εφαρμόζεται στα είδη συστημάτων που εμπίπτουν στις πρώτες τρεις σειρές	Επαρκείς πληροφορίες για το επίπεδο των εντολών ή ζευγών εντολών και του συναλλακτικού ενδιαφέροντος· ειδικότερα, τα πέντε καλύτερα επίπεδα τιμών αγοράς και πώλησης και/ή ζεύγη εντολών για κάθε ειδικό διαπραγματευτή στη σχετική μετοχή, εφόσον το επιτρέπουν τα χαρακτηριστικά του μηχανισμού αναζήτησης τιμών

Πίνακας 2
Εντολές μεγάλου μεγέθους σε σχέση με τις εντολές κανονικού μεγέθους

(σε ευρώ)

Κατηγορία από άποψη μέσης ημερήσιας αξίας συναλλαγών (ΜΗΑΣ)	ΜΗΑΣ < 500 000	500 000 ≤ ΜΗΑΣ < 1 000 000	1 000 000 ≤ ΜΗΑΣ < 25 000 000	25 000 000 ≤ ΜΗΑΣ < 50 000 000	ΜΗΑΣ ≥ 50 000 000
Ελάχιστο μέγεθος εντολής που θεωρείται μεγάλου μεγέθους σε σχέση με τις εντολές κανονικού μεγέθους	50 000	100 000	250 000	400 000	500 000

Πίνακας 3
Σύνηθες μέγεθος στην αγορά

(σε ευρώ)

Κατηγορία από άποψη μέσης αξίας εκτελεσθεισών συναλλαγών (ΜΑΣ)	ΜΑΣ < 10 000	10 000 ≤ ΜΑΣ < 20 000	20 000 ≤ ΜΑΣ < 30 000	30 000 ≤ ΜΑΣ < 40 000	40 000 ≤ ΜΑΣ < 50 000	50 000 ≤ ΜΑΣ < 70 000	70 000 ≤ ΜΑΣ < 90 000	κ.λπ.
Σύνηθες μέγεθος στην αγορά	7 500	15 000	25 000	35 000	45 000	60 000	80 000	κ.λπ.

Πίνακας 4

Όρια και προθεσμίες αναβολής δημοσίευσης

Στον παρακάτω πίνακα αναγράφεται, για κάθε επιτρεπόμενη αναβολή δημοσίευσης και για κάθε κατηγορία μετοχών από την άποψη της μέσης ημερήσιας αξίας συναλλαγών, το ελάχιστο απαιτούμενο μέγεθος συναλλαγής (ΜΗΑΣ) για το οποίο μπορεί να επιτραπεί η αναβολή για μια μετοχή της σχετικής κατηγορίας.

		Κατηγορία μετοχών από άποψη μέσης ημερήσιας αξίας συναλλαγών (ΜΗΑΣ)			
		ΜΗΑΣ < 100 000 ευρώ	100 000 ευρώ ≤ ΜΗΑΣ < 1 000 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ ≤ ΜΗΑΣ < 50 000 000 ευρώ	ΜΗΑΣ ≥ 50 000 000 ευρώ
		Ελάχιστο απαιτούμενο μέγεθος συναλλαγής για την επιτρεπόμενη αναβολή			
Επιτρεπόμενη αναβολή δημοσίευσης	60 λεπτά	10 000 ευρώ	5 % του ΜΗΑΣ ή 25 000 ευρώ, όποιο είναι μεγαλύτερο	10 % του ΜΗΑΣ ή 3 500 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο	10 % του ΜΗΑΣ ή 7 500 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο
	180 λεπτά	25 000 ευρώ	15 % του ΜΗΑΣ ή 75 000 ευρώ, όποιο είναι μεγαλύτερο	15 % του ΜΗΑΣ ή 5 000 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο	20 % του ΜΗΑΣ ή 15 000 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο
	Έως το τέλος της ημέρας διαπραγμάτευσης (ή μετακύλιση στο μεσημέρι της επομένης, εάν η συναλλαγή έγινε τις δύο τελευταίες ώρες της ημέρας διαπραγμάτευσης)	45 000 ευρώ	25 % του ΜΗΑΣ ή 100 000 ευρώ, όποιο είναι μεγαλύτερο	25 % του ΜΗΑΣ ή 10 000 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο	30 % του ΜΗΑΣ ή 30 000 000 ευρώ, όποιο είναι μικρότερο
	Έως το τέλος της επόμενης εργάσιμης ημέρας μετά τη συναλλαγή	60 000 ευρώ	50 % του ΜΗΑΣ ή 100 000 ευρώ, όποιο είναι μεγαλύτερο	50 % του ΜΗΑΣ ή 1 000 000 ευρώ, όποιο είναι μεγαλύτερο	100 % του ΜΗΑΣ
	Έως το τέλος της δεύτερης εργάσιμης ημέρας μετά τη συναλλαγή	80 000 ευρώ	100 % του ΜΗΑΣ	100 % του ΜΗΑΣ	250 % του ΜΗΑΣ
	Έως το τέλος της τρίτης εργάσιμης ημέρας μετά τη συναλλαγή		250 % του ΜΗΑΣ	250 % του ΜΗΑΣ	