

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/575

2016 m. birželio 8 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų papildoma techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su sandorių vykdymo kokybės duomenimis, kuriuos turi skelbti vykdymo vietos

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamos Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES ⁽¹⁾, ypač į jos 27 straipsnio 10 dalies pirmos pastraipos a punktą,

kadangi:

- (1) siekiant suteikti tiek viešosioms, tiek investicinėms įmonėms svarbių duomenų apie pavedimų vykdymo kokybę, kad jos galėtų nustatyti geriausią klientų pavedimų vykdymo būdą, svarbu nustatyti su finansinių priemonių, kurioms taikoma Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 600/2014 ⁽²⁾ 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, vykdymo kokybe susijusių duomenų, kuriuos turi skelbti prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai, konkretų turinį, formą ir skelbimo periodiškumą. Taip pat svarbu nustatyti su kitų finansinių priemonių, kurioms netaikoma prekybos pareiga, vykdymo kokybe susijusių duomenų, kuriuos turi skelbti vykdymo vietos, konkretų turinį, formą ir skelbimo periodiškumą. Šiuo atveju reikėtų tinkamai atsižvelgti į vykdymo vietos rūšį ir susijusios finansinės priemonės rūšį;
- (2) siekiant išsamiai įvertinti Sąjungoje atliekamų sandorių vykdymo kokybės mastą, tikslinga, kad vykdymo vietos, kurias investicinės įmonės gali pasirinkti, kad šios vykdytų klientų pavedimus, laikytųsi reikalavimų dėl duomenų, kuriuos pagal šį reglamentą turi teikti vykdymo vietos. Šiuo tikslu prie šių vykdymo vietų reikėtų priskirti reguliuojamas rinkas, daugiašales prekybos sistemas, organizuotas prekybos sistemas, sistemingai sandorius savo viduje sudarančius tarpininkus, rinkos formuotojus ir kitus likvidumo teikėjus;
- (3) remiantis tuo, kad yra skirtingų rūšių vykdymo vietų ir finansinių priemonių, teikiamos informacijos turinys turėtų skirtis priklausomai nuo keleto veiksnių. Siekiant susidaryti tinkamą vykdymo kokybės vaizdą, tikslinga diferencijuoti pranešamų duomenų kiekį ir pobūdį pagal prekybos sistemas, prekybos būdus ir prekybos platformas;
- (4) siekiant išvengti netinkamo vykdymo vietų palyginimo ir užtikrinti surinktų duomenų svarbumą, vykdymo vietos turėtų teikti atskirus pranešimus, atitinkančius tuos segmentus, kuriuose naudojamos skirtingos pavedimų knygos arba kurie kitaip reguliuojami ar kuriuose naudojami skirtingi rinkos segmentų identifikatoriai;
- (5) siekdamas užtikrinti tikslų faktinio įvykdymo kokybės vaizdą, prekybos vietos kartu su įvykdytais pavedimais neturėtų skelbti tų, kuriais prekiaujama ne biržoje ir apie kuriuos pranešama prekybos vietai;
- (6) kai rinkos formuotojai ir kiti likvidumo teikėjai kaip vykdymo vietos skelbia informaciją apie finansines priemones, kurioms netaikoma prekybos pareiga, jie turėtų skelbti tik informaciją apie įvykdytus pavedimus arba jų klientams pateiktą kotiruotę, kai pavedimai arba kotiruojami, arba vykdomi ne biržoje arba vykdomi pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ir 9 straipsnius, neįskaitant pavedimų, kurie saugomi prekybos vietos pavedimų valdymo sistemoje, kol neatskleidžiama informacija;
- (7) tikslinga laikyti, kad kitiems likvidumo teikėjams reikėtų priskirti įmones, kurios teigia norinčios vykdyti sandorius savo sąskaita ir kurios teikia likvidumą vykdydamos savo įprastą verslo veiklą, nepriklausomai nuo to, ar turi sudariusios oficialius susitarimus ir ar įsipareigoja nuolat teikti likvidumą;

⁽¹⁾ OL L 173, 2014 6 12, p. 349.

⁽²⁾ 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 173, 2014 6 12, p. 84).

- (8) siekiant užtikrinti su kaina susijusį visišką sandorių vykdymo kokybės skaidrumą, tikslinga, kad pateikta su kaina susijusi informacija atitinkamais atvejais neapimtų jokių komisinių ar sukauptų palūkanų;
- (9) nustatant tinkamą informaciją kainos kokybei įvertinti, turėtų būti reikalaujama tiek kasdien skelbiamos informacijos apie vidutinius lygius, tiek konkretaus laiko momento informacijos. Turėdami tokios informacijos, dalyviai, analizuodami įvykdymo kokybę, žinos atitinkamas aplinkybes ir galės susidaryti išsamesnį vaizdą. Kad būtų galima palyginti finansinių priemonių kainas, taip pat reikia nurodyti bet kurio pranešamo sandorio valiutos kodą;
- (10) siekiant užtikrinti reguliavimo nuoseklumą, netikslinga reikalauti, kad prekybos vietos pateiktų informacijos apie sandorius, kuriems paskelbimo metu ir toliau taikomas viešo paskelbimo atidėjimas, laikantis skaidrumo sudarius sandorį reikalavimų. Tikslinga, kad sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, rinkos formuotojams ir kitiems likvidumo teikėjams būtų netaikomas reikalavimas skelbti konkretaus laiko momento duomenis apie sandorius, viršijančius standartinį rinkos dydį arba finansinei priemonei būdingą dydį, kad tos vietos išvengtų pernelyg didelės neskelbtinos komercinės informacijos atskleidimo rizikos, kuri galėtų pakenkti jų gebėjimui apdrausti pozicijas ir teikti likvidumą. Akcijų, biržinių fondų ir sertifikatų, kurie pagal Reglamentą (ES) Nr. 600/2014 laikomi nelikvidžiais, atžvilgiu taikytina standartinio rinkos dydžio riba yra tos rūšies finansinės priemonės mažiausias standartinis rinkos dydis. Siekiant išvengti netikrumo, tikslinga paaiškinti, kad nuoroda į didelę apimtį ir į finansinei priemonei būdingą dydį turi tą pačią reikšmę, kuri nurodyta skaidrumo sudarius sandorį reikalavimuose;
- (11) labai svarbu, kad tam tikroje vietoje vykdant pavedimą visi taikyti mokesčiai būtų visiškai skaidrūs. Būtina nurodyti visas kliento pavedimo vykdymo sąnaudas, kurios susijusios su konkrečios vietos naudojimu ir kurias klientas apmoka tiesiogiai arba netiesiogiai. Tos sąnaudos turėtų apimti vykdymo mokesčius, įskaitant pavedimų pateikimo, pakeitimo arba anuliavimo mokesčius arba kotiruočių atšaukimo mokesčius, taip pat bet kokius mokesčius, susijusius su galimybe gauti rinkos duomenų arba naudotis terminalais. Susijusios sąnaudos taip pat gali apimti tarpuskaitymo ar atsiskaitymo mokesčius arba bet kokius kitus mokesčius, mokamus trečiosioms šalims, kurios dalyvauja vykdant pavedimą per vykdymo vietų teikiamas paslaugas. Informacija apie sąnaudas taip pat turėtų apimti mokesčius ar rinkliavas, kuriuos tiesiogiai turi apmokėti vieta arba kuriuos ji patiria narių ar vykdymo vietos naudotojų arba kliento, su kuriuo susijęs pavedimas, vardu;
- (12) vykdymo tikimybė rodo tam tikros rūšies pavedimo vykdymo galimumą ir yra grindžiama konkrečios priemonės prekybos apimtys duomenimis arba kitomis pavedimų ir sandorių ypatybėmis. Turint informacijos apie vykdymo tikimybę, turėtų būti galima apskaičiuoti tokius parametrus, kaip vietai būdingą konkrečios finansinės priemonės ar finansinių priemonių klasės santykinį rinkos dydį. Vykdymo tikimybė taip pat turėtų būti vertinama atsižvelgiant į neįvykusių sandorių arba anuliuotų ar pakeistų pavedimų duomenis;
- (13) vykdymo greitis gali turėti skirtingas reikšmes skirtingų rūšių vykdymo vietų atveju, nes greičio vertinimas prekybos sistemų ir prekybos platformos atveju skiriasi. Nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono atveju vykdymo greitis turėtų būti išreikštas milisekundėmis, o taikant kitas prekybos sistemas tikslinga naudoti didesnius laiko vienetus. Taip pat tikslinga neįtraukti tam tikro dalyvio prisijungimo prie vykdymo vietos delsos, nes pati vykdymo vieta to negali kontroliuoti;
- (14) siekiant palyginti skirtingo dydžio pavedimų vykdymo kokybę, vykdymo vietos turėtų būti įpareigosotos pateikti informaciją apie kelių dydžių intervalų sandorius. Šių intervalų ribos turėtų priklausyti nuo finansinės priemonės rūšies ir jos likvidumo, siekiant užtikrinti, kad būtų pateikta tinkama tai priemonei būdingo dydžio įvykdytų pavedimų imtis;
- (15) svarbu, kad vykdymo vietos rinktų duomenis įprastomis savo veiklos valandomis. Todėl informacija turėtų būti teikiama nemokamai, kompiuteriu skaitoma elektronine forma interneto svetainėje, kad visuomenė galėtų visus pateiktus duomenis parsisiųsti, atlikti jų paiešką, juos klasifikuoti ir analizuoti;
- (16) vykdymo vietų pranešimus turėtų papildyti konsoliduotos informacinės juostos teikėjo, nustatyto Direktyva 2014/65/ES, pateikiama informacija, taip sudarant sąlygas kurti geresnes vykdymo kokybės priemones;

- (17) nuoseklos sumetimais ir siekiant užtikrinti sklandų finansų rinkų veikimą, būtina, kad šiame reglamente ir Direktyvoje 2014/65/ES bei Reglamente (ES) Nr. 600/2014 nustatytos nuostatos būtų pradėtos taikyti nuo tos pačios dienos;
- (18) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktais techninių reguliavimo standartų projektais;
- (19) EVPRI dėl techninių reguliavimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ 37 straipsniu, pateikti savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Dalykas

Šiame reglamente nustatomas su sandorių vykdymo kokybe susijusių duomenų, kuriuos turi skelbti vykdymo vietos, konkretus turinys, forma ir skelbimo periodiškumas. Jis taikomas prekybos vietoms, sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, rinkos formuotojams ar kitiems likvidumo teikėjams.

2 straipsnis

Apibrėžtys

Šiame reglamente vartojamų terminų apibrėžtys:

- a) prekybos sistema – būdas, kuriuo vykdymo vieta vykdo pavedimus, kaip antai nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono sistema, nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistema, prašymų dėl kotiruočių sistema, periodinio aukciono sistema arba bet kuri hibridinė sistema, priskiriama prie dviejų ar daugiau iš šių kategorijų arba priskiriama sistemai, pagal kurią kainos nustatymo procesas yra kitokio pobūdžio nei tas, kuris taikomas pirmiau nurodytų rūšių sistemoms;
- b) finansinei priemonei būdingas dydis – dydis, būdingas obligacijai, struktūrizuotam finansiniam produktui, apyvartiniam taršos leidimui ar išvestinei finansinei priemonei, kuriais prekiaujama prekybos vietoje ir kurių rinka nėra likvidi, kai tų priemonių sandoriui taikomas atidėtas duomenų skelbimas pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnį;
- c) didelės apimties – didelės apimties pavedimas pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 7 ir 11 straipsnius;
- d) neįvykęs sandoris – sandoris, kurį vykdymo vieta pripažino negaliojančiu;
- e) kainos daugiklis – pagrindinės finansinės priemonės, kurią atitinka viena išvestinės finansinės priemonės sutartis, vienetų skaičius;
- f) kainos žymėjimas – nurodymas, ar sandorio kaina išreikšta pinigine verte, procentine dalimi ar pajamingumu;
- g) kiekio žymėjimas – nurodymas, ar sandorio kiekis išreikštas vienetų skaičiumi, nominaliąja verte ar pinigine verte;
- h) pateikimo rūšis – nurodymas, ar pagal finansinę priemonę atsiskaitoma fiziškai ar pinigais, įskaitant atvejus, kai sandorio šalis būdą gali pasirinkti ar kai jį nustato trečioji šalis;
- i) prekybos būdas – tvarkaraštinis pradinis, baigiamasis ar dienos aukcionas, netvarkaraštinis aukcionas, prekyba uždarant rinką, prekyba ne pagrindinės sesijos metu ar pranešimas apie prekybos rezultatus;
- j) prekybos platforma – vykdymo vietos naudojamos platformos rūšis: elektroninė, žodinė ar atviro šaukimo;

⁽¹⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

- k) knygos apimtis – bendras esamas likvidumas, išreikštas nurodyto skaičiaus kainos padidėjimų, palyginti su geriausios pirkimo ir pardavimo kainos viduriniu tašku, visų pirkimo ir pardavimo pasiūlymų kainų ir apimties sandauga;
- l) vidutinis faktinis pirkimo ir pardavimo kainų skirtumas – iš karto vykdomų rinkos pavedimų ar parduotinių limituotų pavedimų atveju dvigubo skirtumo tarp faktinės vykdymo kainos ir geriausios pirkimo ir pardavimo kainos vidurinio taško vidurkis;
- m) nepakeistų pasyvių pavedimų vykdymo geriausia pirkimo ir pardavimo kaina vidutinis greitis – vidutinis laikas nuo to momento, kai vykdymo vieta gauna limituotą pavedimą, atitinkantį geriausią pirkimo ir pardavimo kainą, iki paskesnio šio pavedimo įvykdymo;
- n) agresyvus pavedimas – į pavedimų knygą įrašytas pavedimas, kuriuo panaudotas likvidumas;
- o) pasyvus pavedimas – į pavedimų knygą įrašytas pavedimas, kuriuo suteiktas likvidumas;
- p) pavedimas įvykdyti iš karto arba anuliuoti (angl. *immediate or cancel order*) – pavedimas, kuris vykdomas iš karto jį įrašius į pavedimų knygą ir joje nelieta jokių likusio neįvykdyto kiekio pavidalu;
- q) pavedimas įvykdyti arba anuliuoti (angl. *fill or kill order*) – pavedimas, kuris vykdomas jį įrašius į pavedimų knygą su sąlyga, kad jį galima visiškai įvykdyti. Jeigu pavedimą galima įvykdyti tik iš dalies, tuomet jis automatiškai atmetamas ir nevykdomas.

3 straipsnis

Informacijos apie vykdymo vietą ir finansinę priemonę skelbimas

1. Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal trečią pastraipą skelbia informaciją apie vykdymo vietos rūšį.

Vykdymo vietos kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal trečią pastraipą skelbia informaciją apie vykdymo vietos rūšį.

Priedo 1 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- i) vykdymo vietos pavadinimas ir vietos identifikatorius;
- ii) šalis, kurioje įsikūrusi kompetentinga institucija;
- iii) rinkos segmento pavadinimas ir rinkos segmento identifikatorius;
- iv) prekybos dienos data;
- v) bet kokio veiklos nutraukimo įprastu vietos prekybos laikotarpiu, dėl kurio prekybos dieną sustojo prekyba visomis tos vietos turimomis prekybai skirtomis priemonėmis, pobūdis, atvejų skaičius ir vidutinė trukmė;
- vi) bet kokių tvarkaraščių aukcionų įprastu vietos prekybos laikotarpiu prekybos dieną pobūdis, skaičius ir vidutinė trukmė;
- vii) neįvykusių sandorių skaičius prekybos dieną;
- viii) neįvykusių sandorių vertė, išreikšta sandorių, įvykdytų prekybos dieną, bendros vertės procentine dalimi.

2. Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal trečią pastraipą skelbia informaciją apie finansinės priemonės rūšį.

Vykdymo vietos kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą skelbia informaciją apie finansinės priemonės rūšį.

Priedo 2 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) finansinių priemonių, kurios turi priedo 2 lentelėje nustatytus identifikatorius, atveju:
 - i) finansinės priemonės identifikatoriaus pavadinimas;
 - ii) priemonės klasė;
 - iii) valiuta;
- b) finansinių priemonių, kurios neturi priedo 2 lentelėje nustatytų identifikatorių, atveju:
 - i) priemonės pavadinimas ir aprašas, įskaitant pagrindinės finansinės priemonės valiutą, kainos daugiklį, kainos žymėjimą, kiekio žymėjimą ir pateikimo rūšį;
 - ii) priemonės klasė;
 - iii) valiuta.

4 straipsnis

Kaina

Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią ir ketvirtą pastraipą skelbia informaciją apie kiekvienos prekybos dienos, kurią vykdyti finansinės priemonės pavedimai, kainas.

Vykdyto vietos kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią ir ketvirtą pastraipą skelbia informaciją apie kiekvienos prekybos dienos, kurią vykdyti finansinės priemonės pavedimai, kainas.

Skelbiama ši informacija:

- a) dienos informacija:
 - i) prekybos vietoms: paprasta vidutinė visų sandorių, įvykdytų per pirmas dvi minutes nuo kiekvieno nurodyto tos dienos laiko: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 ir 15.30.00 val. UTC (suderintojo pasaulinio laiko) pagal kiekvieną dydžio intervalą, nurodytą 9 straipsnyje, kaina;
 - ii) sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, rinkos formuotojams ir kitiems likvidumo teikėjams: paprasta vidutinė visų sandorių, įvykdytų per pirmas dvi minutes nuo kiekvieno nurodyto tos dienos laiko: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 ir 15.30.00 val. UTC (suderintojo pasaulinio laiko) dydžio intervale Nr. 1, nurodytame 9 straipsnyje, kaina;
 - iii) prekybos sandorių, įvykdytų per i ir ii papunkčiuose nurodytą dviejų minučių laikotarpį, bendra vertė;
 - iv) prekybos vietoms: jeigu per pirmas dvi i papunktyje nurodytų atitinkamų laikotarpių minutes neįvyko jokių sandorių, pirmojo sandorio, jeigu toks buvo, įvykdyto kiekviename dydžio intervale, nurodytame 9 straipsnyje, po kiekvieno i punkte nurodyto tos dienos laiko, kaina;
 - v) sistemingai sandorius savo viduje sudarantiems tarpininkams, rinkos formuotojams ir kitiems likvidumo teikėjams: jeigu per pirmas dvi ii papunktyje nurodytų atitinkamų laikotarpių minutes neįvyko jokių sandorių, pirmojo sandorio, jeigu toks buvo, įvykdyto dydžio intervale Nr. 1, nurodytame 9 straipsnyje, po kiekvieno ii papunktyje nurodyto tos dienos laiko, kaina;
 - vi) kiekvieno sandorio, nurodyto iv ir v papunkčiuose, vykdymo laikas;
 - vii) kiekvieno įvykdyto sandorio, nurodyto iv ir v papunkčiuose, dydis pagal vertę;
 - viii) prekybos sistema ir prekybos režimas, kuriuos taikant įvykdyti iv ir v papunkčiuose nurodyti sandoriai;
 - ix) prekybos platforma, kurioje įvykdyti iv ir v papunkčiuose nurodyti sandoriai;
 - x) kiekvieno įvykdyto sandorio, nurodyto iv ir v papunkčiuose, geriausia pirkimo ir pardavimo kaina arba tinkama referencinė kaina vykdymo metu.

Dienos informacija skelbiama priedo 3 lentelėje nustatyta forma.

b) kasdien skelbiama informacija:

- i) paprasta vidutinė ir pagal apimtį įvertinta vidutinė sandorio kaina, jeigu įvyko daugiau nei vienas sandoris;
- ii) didžiausia įvykdyto sandorio kaina, jeigu įvyko daugiau nei du sandoriai;
- iii) mažiausia įvykdyto sandorio kaina, jeigu įvyko daugiau nei du sandoriai.

Kasdien skelbiama informacija nurodoma priedo 4 lentelėje nustatyta forma.

5 straipsnis

Sąnaudos

Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia informaciją apie sąnaudas, kurias prekybos vieta numato bet kuriems nariams ar vietos naudotojams.

Vykdyto vietos kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia informaciją apie sąnaudas, kurias vykdyto vietos numato bet kuriems nariams ar vietos naudotojams.

Priedo 5 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) aprašymas, kuriame nurodomas vykdyto vietos numatomų sąnaudų visų sudedamųjų dalių pobūdis ir lygis prieš taikant bet kokias lengvatas ar nuolaidas, ir informacija apie tai, kaip tos sąnaudos skiriasi pagal susijusius naudotojus ar finansines priemones, bei atitinkamos sumos, kuriomis tos sąnaudos skiriasi. Sudedamosios sąnaudų dalys apima:
 - i) vykdyto mokesčius;
 - ii) pavedimų pateikimo, pakeitimo ar anuliavimo mokesčius arba kotiruočių atšaukimo mokesčius;
 - iii) mokesčius, susijusius su galimybe gauti rinkos duomenų arba naudotis terminalais;
 - iv) bet kuriuos tarpuskaitymo ir atsiskaitymo mokesčius ir bet kuriuos kitus mokesčius, mokamus trečiosioms šalims, kurios dalyvavo vykdant pavedimą;
- b) bet kokių lengvatų, nuolaidų ar kitų išmokų, siūlomų vykdyto vietos naudotojams, pobūdžio ir lygio aprašymas, įskaitant informaciją apie tai, kaip tos lengvatos, nuolaidos ar kitos išmokos skiriasi pagal susijusius naudotojus ar finansines priemones, ir sumas, kuriomis tos lengvatos, nuolaidos ar kitos išmokos skiriasi;
- c) bet kokių nepiniginių atlygių, siūlomų vykdyto vietos naudotojams, pobūdžio aprašymas ir sumos, įskaitant informaciją apie tai, kaip tie nepigininiai atlygiai skiriasi pagal susijusius naudotojus ar finansines priemones, ir vertę, kuria tie atlygiai skiriasi;
- d) bet kurių mokesčių ar rinkliavų, kuriuos tiesiogiai turi apmokėti vykdyto vieta arba kuriuos ji patiria narių ar vykdyto vietos naudotojų vardu, pobūdžio ir lygio aprašymas;
- e) nuoroda į vietos interneto svetainę ar kitą šaltinį, iš kurio galima gauti papildomos informacijos apie sąnaudas;
- f) b ir c punktuose nurodytų visų lengvatų, nuolaidų, nepiniginių atlygių ar kitų išmokų bendra vertė, išreikšta prekybos bendros vertės per ataskaitinį laikotarpį procentine dalimi;
- g) visų a punkte nurodytų sąnaudų bendra vertė, neįskaitant b ir c punktuose nurodytų lengvatų ir nuolaidų, nepiniginių atlygių ar kitų išmokų bendros vertės, išreikšta prekybos bendros vertės per ataskaitinį laikotarpį procentine dalimi.

6 straipsnis

Vykdyto tikimybė

Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia informaciją, susijusią su vykdyto tikimybe kiekvieną prekybos dieną.

Vykdyto vietos kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia informaciją, susijusią su vykdymo tikimybe kiekvieną prekybos dieną.

Priedo 6 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių skaičius;
- b) įvykdytų sandorių, jei jų buvo daugiau nei vienas, skaičius ir vertė;
- c) gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių, kurie buvo anuliuoti arba atšaukti, neįskaitant pasyvių pavedimų su galiojimo pabaigos arba anuliavimo dienos pabaigoje nurodymais, skaičius;
- d) gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių, kurie buvo pakeisti tą dieną, skaičius;
- e) sandorio dydžio mediana tą dieną, jeigu įvyko daugiau nei vienas sandoris;
- f) visų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių dydžio mediana tą dieną, jei gautas daugiau nei vienas pavedimas ar prašymas dėl kotiruočių;
- g) paskirtų rinkos formuotojų skaičius.

7 straipsnis

Papildoma informacija vykdymo vietoms, naudojančioms nepertraukiamą pavedimų knygos aukcioną ir nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą

1. Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai, naudojančios nepertraukiamą pavedimų knygos aukcioną, nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą 4 straipsnio a punkto i ir ii papunkčiuose nurodytu laiku skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Vykdyto vietos, naudojančios nepertraukiamą pavedimų knygos aukcioną, nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą 4 straipsnio a punkto i ir ii papunkčiuose nurodytu laiku skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Priedo 7 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- i) geriausia pirkimo ir pardavimo kaina bei atitinkama apimtis;
- ii) knygos apimtis trims kainos padidinimams.

2. Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai, naudojančios nepertraukiamą pavedimų knygos aukcioną, nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Vykdyto vietos, naudojančios nepertraukiamą pavedimų knygos aukcioną, nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Priedo 8 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) vidutinis faktinis pirkimo ir pardavimo kainų skirtumas;
- b) vidutinė apimtis esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai;
- c) vidutinis pirkimo ir pardavimo kainų skirtumas esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai;
- d) anuliuavimo atvejų skaičius esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai;
- e) pakeitimų skaičius esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai;
- f) vidutinė knygos apimtis trims kainos padidinimams;

- g) laiko, praėjusio nuo to momento, kai vykdymo vieta gavo agresyvų pavedimą ar priėmė kotiruotę, iki visiško ar dalinio įvykdymo, vidurkis ir mediana;
- h) nepakeistų pasyvių pavedimų vykdymo geriausia pirkimo ir pardavimo kaina vidutinis greitis;
- i) neįvykusių pavedimų įvykdyti arba anuliuoti (angl. *fill or kill*) skaičius;
- j) pavedimų įvykdyti iš karto arba anuliuoti, kurie nebuvo įvykdyti, skaičius;
- k) prekybos vietoje įvykdytų sandorių, kurie yra didelės apimties pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ar 9 straipsnius, skaičius ir vertė;
- l) sandorių, įvykdytų prekybos vietoje pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ar 9 straipsnius, skaičius ir vertė, neįskaitant pavedimų, kurie saugomi prekybos vietos pavedimų valdymo sistemoje, kol neatskleidžiama informacija, ir kurie neįtraukti į k punktą;
- m) prekybos nutraukimų dėl svyruojančių kainų aukciono ar sistemos išjungiklio, kurie įvyko įprastu vietos prekybos laikotarpiu, skaičius ir vidutinė trukmė;
- n) prekybos sustabdymo, kuris įvyko dėl vietos sprendimo įprastu vietos prekybos laikotarpiu ir kuris nepriskiriamas prie tų, apie kuriuos pranešta pagal 3 straipsnio 1 dalies v punktą, pobūdis, atvejų skaičius ir vidutinė trukmė.

3. Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai, naudojantys visą nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar jos dalį, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą skelbia papildomą informaciją.

Vykdymo vietos, naudojančios visą nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemą ar jos dalį, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šios dalies trečią pastraipą skelbia papildomą informaciją.

Priedo 8 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) bet kurių laikotarpių įprastomis prekybos valandomis, trunkančių ilgiau nei 15 minučių, per kuriuos nepateikta pirkimo ar pardavimo pavedimų, skaičius ir vidutinė trukmė kiekvieną prekybos dieną;
- b) vidutinis esamų kotiruočių kiekis, išreikštas tos dienos įprasto vietos prekybos laikotarpio procentine dalimi.

8 straipsnis

Papildoma informacija vykdymo vietoms, naudojančioms prašymų dėl kotiruočių sistemą

Prekybos vietos ir sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai, naudojantys prašymų dėl kotiruočių prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Vykdymo vietos, naudojančios prašymų dėl kotiruočių prekybos sistemą ar kitos rūšies prekybos sistemą, kurioje galima gauti tą informaciją, kiekvieno rinkos segmento, kuriame vykdo veiklą, ir kiekvienos finansinės priemonės, kuriai netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 ir 28 straipsniuose nustatyta prekybos pareiga, atveju pagal šio straipsnio trečią pastraipą skelbia kiekvienos prekybos dienos papildomą informaciją.

Priedo 9 lentelėje nustatyta forma skelbiama ši informacija:

- a) laiko, praėjusio nuo kotiruotės priėmimo iki įvykdymo visų tos finansinės priemonės sandorių atžvilgiu, trukmės vidurkis ir mediana;
- b) laiko, praėjusio nuo prašymo dėl kotiruotės gavimo iki bet kurių atitinkamų kotiruočių pateikimo visų tos finansinės priemonės kotiruočių atžvilgiu, trukmės vidurkis ir mediana.

9 straipsnis

Intervalų, apie kuriuos teiktina informacija, nustatymas

Vykdyto vietos teikia informaciją apie įvykdytus sandorius, nurodytus 4 straipsnyje, pagal šiuos intervalus:

- a) visų finansinių priemonių, išskyrus pinigų rinkos priemones, atveju:
 - i) intervalas Nr. 1: didesni nei 0 EUR ir atitinkantys standartinį rinkos dydį arba finansinei priemonei būdingą dydį arba už juos mažesni;
 - ii) intervalas Nr. 2: didesni už standartinį rinkos dydį arba finansinei priemonei būdingą dydį ir atitinkantys didelės apimties sandorius arba už juos mažesni;
 - iii) intervalas Nr. 3: didesni už didelės apimties sandorius;
- b) nelikvidžių akcijų, biržinių fondų ar sertifikatų atveju:
 - i) intervalas Nr. 1: didesni nei 0 EUR ir atitinkantys tos rūšies priemonės mažiausią esamą standartinį rinkos dydį arba už jį mažesni;
 - ii) intervalas Nr. 2: didesni už tos rūšies priemonės mažiausią esamą standartinį rinkos dydį ir atitinkantys didelės apimties sandorius arba už juos mažesni;
 - iii) intervalas Nr. 3: didesni už didelės apimties sandorius;
- c) pinigų rinkos priemonių atveju:
 - i) intervalas Nr. 1: didesni nei 0 EUR ir lygūs 10 mln. EUR arba mažesni;
 - ii) intervalas Nr. 2: didesni nei 10 mln. EUR ir lygūs 50 mln. EUR arba mažesni;
 - iii) intervalas Nr. 3: didesni nei 50 mln. EUR.

10 straipsnis

Skelbimo forma

Vykdyto vietos skelbia kiekvienos prekybos dienos informaciją, naudodamos priede pateiktus šablonus elektronine, kompiuteriu skaitoma forma, kurią visuomenė gali parsisiųsti internetu.

11 straipsnis

Skelbtinos informacijos periodiškumas

Vykdyto vietos skelbia informaciją kiekvieną ketvirtį, ne vėliau kaip per tris mėnesius po kiekvieno ketvirčio pabaigos:

- a) iki birželio 30 d. – informaciją apie laikotarpį nuo sausio 1 d. iki kovo 31 d.;
- b) iki rugsėjo 30 d. – informaciją apie laikotarpį nuo balandžio 1 d. iki birželio 30 d.;
- c) iki gruodžio 31 d. – informaciją apie laikotarpį nuo liepos 1 d. iki rugsėjo 30 d.;
- d) iki kovo 31 d. – informaciją apie laikotarpį nuo spalio 1 d. iki gruodžio 31 d.

12 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2018 m. sausio 3 d.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2016 m. birželio 8 d.

Komisijos vardu

Pirmininkas

Jean-Claude JUNKER

	Dydžio inter-valas	Visi prekybos sandoriai, įvykdyti per pirmas dvi minutes po laiko T		Pirmas sandoris po laiko T (jeigu nėra sandorių per pirmas dvi minutes po laiko T)						
Laikas (T)		Įvykdyto sandorio kainos paprastas vidurkis (neįskaitant komisinių ir sukauptų palūkanų)	Bendra įvykdytų sandorių vertė	Kaina	Vykdy-mo laikas	Sandorio dydis	Prekybos sistema	Prekybos būdas	Prekybos plat-forma	Geriausia pirkimo ir pardavimo kaina arba tinkama referen-cinė kaina vykdymo metu
13.30.00	1									
	2									
	3									
15.30.00	1									
	2									
	3									

4 lentelė. Skelbtina kainos informacija, kaip nurodyta 4 straipsnio b punkte

sandorio kainos paprastas vidurkis	
pagal apimtį įvertinta sandorio kaina	
didžiausia įvykdyto sandorio kaina	
mažiausia įvykdyto sandorio kaina	

5 lentelė. Skelbtina sąnaudų informacija, kaip nurodyta 5 straipsnyje

Pagal 5 straipsnio a–d punktus reikalaujama pateikti informacija	(Aprašymas)
Nuoroda į interneto svetainę ar kitą šaltinį, iš kurio galima gauti papildomos informacijos apie sąnaudas	
Visų lengvatų, nuolaidų ar kitų siūlomų mokėjimų bendra vertė (kaip prekybos bendros vertės per ataskaitinį laikotarpį %)	%
Visų sąnaudų bendra vertė (kaip prekybos bendros vertės per ataskaitinį laikotarpį %)	%

6 lentelė. Skelbtina vykdymo tikimybės informacija, kaip nurodyta 6 straipsnyje

Gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių skaičius	
Įvykdytų sandorių skaičius	
Bendra įvykdytų sandorių vertė	
Anuliuotų arba atšauktų gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių skaičius	

Pakeistų gautų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių skaičius	
Sandorio dydžio mediana	
Visų pavedimų ar prašymų dėl kotiruočių dydžio mediana	
Paskirtų rinkos formuotojų skaičius	

7 lentelė. Skelbtina vykdymo tikimybės informacija, kaip nurodyta 7 straipsnio 1 dalyje

Laikas	Geriausia pirkimo kaina	Geriausia parda- vimo kaina	Pasiūlymo pirkti dydis	Pasiūlymo parduoti dydis	Knygos apimtis trių kainos padidininų atveju
9.30.00					
11.30.00					
13.30.00					
15.30.00					

8 lentelė. Skelbtina informacija, kaip nurodyta 7 straipsnio 2 ir 3 dalyse

Vidutinis faktinis pirkimo ir pardavimo kainų skirtumas	
Vidutinė apimtis esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai	
Vidutinis pirkimo ir pardavimo kainų skirtumas esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai	
Anuliuotų pavedimų skaičius esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai	
Pakeitimų skaičius esant geriausiai pirkimo ir pardavimo kainai	
Vidutinė knygos apimtis esant trims kainos padidininimams	
Laiko (milisekundėmis), praėjusio nuo to momento, kai vykdymo vieta gavo agresyvų pavedimą ar priėmė kotiruotę, iki visiško ar dalinio paskesnio įvykdymo, vidurkis	
Laiko (milisekundėmis), praėjusio nuo to momento, kai vykdymo vieta gavo rinkos pavedimą, iki visiško ar dalinio paskesnio įvykdymo, mediana	
Nepakeistų pasyvių pavedimų vykdymo geriausia pirkimo ir pardavimo kaina vidutinis greitis	
Neįvykusių pavedimų įvykdyti arba anuliuoti (angl. <i>fill or kill</i>) skaičius	
Pavedimų įvykdyti iš karto arba anuliuoti, kurie nebuvo įvykdyti, skaičius	
Prekybos vietoje įvykdytų sandorių, kurie yra didelės apimties pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ar 9 straipsnius, skaičius	
Prekybos vietoje įvykdytų sandorių, kurie yra didelės apimties pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ar 9 straipsnius, vertė	

Sandorių, įvykdytų prekybos vietoje pagal FPRR 4 ar 9 straipsnius, skaičius, išskyrus pavedimus, kurie saugomi prekybos vietos pavedimų valdymo sistemoje, kol neatskleidžiama informacija, ir kurie nėra didelės apimties	
Sandorių, įvykdytų prekybos vietoje pagal FPRR 4 ar 9 straipsnius, vertė, išskyrus pavedimus, kurie saugomi prekybos vietos pavedimų valdymo sistemoje, kol neatskleidžiama informacija, ir kurie nėra didelės apimties	
Prekybos nutraukimo atvejų skaičius	
Vidutinė prekybos nutraukimo atvejų trukmė	
Prekybos sustabdymo atvejų skaičius	
Prekybos sustabdymo atvejų pobūdis	
Vidutinė prekybos sustabdymo atvejų trukmė	
Nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemos vietų atveju laikotarpių, per kuriuos nepateikta jokių kotiruočių, skaičius	
Nepertraukiamos kotiravimu pagrįstos prekybos sistemos vietų atveju laikotarpių, per kuriuos nepateikta jokių kotiruočių, vidutinė trukmė	
Vidutinis esamų kotiruočių kiekis	

9 lentelė. Skelbtina informacija, kaip nurodyta 8 straipsnyje

Laiko, praėjusio nuo priėmimo iki įvykdymo, vidurkis	
Laiko, praėjusio nuo priėmimo iki įvykdymo, mediana	
Laiko, praėjusio nuo prašymo dėl bet kurių atitinkamų kotiruočių iki jų pateikimo, trukmės vidurkis	
Laiko, praėjusio nuo prašymo dėl bet kurių atitinkamų kotiruočių iki jų pateikimo, trukmės mediana	