

## II

(Незаконодателни актове)

## РЕГЛАМЕНТИ

## ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2023/944 НА КОМИСИЯТА

от 17 януари 2023 година

за изменение и поправка на регулаторните технически стандарти, установени в Делегиран регламент (ЕС) 2017/587, по отношение на някои изисквания за прозрачност при сделките с капиталови инструменти

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 <sup>(1)</sup>, и по-специално член 4, параграф 6, трета алинея, член 7, параграф 2, трета алинея, член 14, параграф 7, трета алинея, член 20, параграф 3, трета алинея, член 22, параграф 3, втора алинея и член 23, параграф 3, трета алинея от него,

като има предвид, че:

- (1) Опитът от прилагането на Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 на Комисията <sup>(2)</sup>, установяването на непоследователно прилагане на разпоредбите, базиращи се на прещенката дали дадена сделка е неценообразуваща, или не, както и характерното за днешното търгуване ускорено, в резултат на технологичното развитие и приспособен към него подход от страна на пазарните участници, публикуване на съответната информация, налагат да се изменят някои разпоредби на посочения делегиран регламент.
- (2) Поднадзорните субекти тълкуват различно понятието „неценообразуваща сделка“, което е от значение за прилагането на предвиденото за договорените сделки освобождаване, на задължението при сделките с акции, както и на освобождаването на двустранните сделки от изискванията за прозрачност след сключването на сделка, което води до публикуването на различни сведения в изпълнение на изискванията за прозрачност след сключването на сделка. С цел да се повишат прозрачността и качеството на данните и оттам – да се улесни обобщаването на данните, е необходимо да се опрости и изясни режимът на докладване на сделките с капиталови инструменти. С цел да се избегне различно тълкуване следва да се съгласуват базиращите се на понятието „неценообразуваща сделка“ разпоредби в Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 и в Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията <sup>(3)</sup>, който урежда докладването на сделките пред компетентните органи. В Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 са посочени всички неподлежащи на изискванията за докладване сделки, поради което отделните сделки в Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 следва да бъдат заличени.

<sup>(1)</sup> ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 84.

<sup>(2)</sup> Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 на Комисията от 14 юли 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за изискванията за прозрачност към местата на търговия и инвестиционните посредници по отношение на акциите, депозитарните разписки, борсово търгуваните фондове, сертификатите и другите подобни финансови инструменти, както и за задълженията за изпълнение на сделките при някои търгувани на място на търговия акции или от страна на систематичен участник (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 387).

<sup>(3)</sup> Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията от 28 юли 2016 г. за допълнение на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за докладването на сделки пред компетентните органи (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 449).

- (3) Съгласуването на понятието „неценообразуваща сделка“ с това понятие в Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 прави излишна дефиницията на „прехвърляне на клиентска сделка“ или „получаване на клиентска сделка“, тъй като тя се използва само в разпоредбите, отнасящи се до въпросното понятие. От своя страна, дефиницията на „сделка за финансиране с ценни книжа“ не се използва в посочения делегиран регламент. Поради това тези дефиниции следва да бъдат заличени.
- (4) С прилагането на Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 се повишиха изискванията за прозрачност преди сключването на сделка при капиталовите и квазикапиталовите инструменти, но прозрачността в реално време преди сключването на сделка при борсово търгуване остана сравнително ниска. Това се дължи на значителния като брой и обем дял на сделките с борсово търгуване фондове, понастоящем ползващи се от освобождаване – в частност предвиденото в член 4, параграф 1, буква в) от Регламент (ЕС) № 600/2014 освобождаване поради голям размер. Това възпрепятства пълноценното постигане на целта на посочения регламент за повишаване на прозрачността при борсово търгуване фондове. За повишаването на прозрачността в реално време преди сключването на сделка при борсово търгуване фондове е необходимо да се увеличи прагът за голям размер, над който сделките с борсово търгуване фондове се освобождават от изискванията за прозрачност преди сключването на сделка. С увеличаването на прага изискванията за прозрачност в реално време преди сключването на сделка ще обхванат повече сделки с борсово търгуване фондове, като в същото време големите по размер нареждания ще бъдат достатъчно защитени от ценови въздействия.
- (5) Прозрачността след сключването на сделка при борсово търгуване фондове също е ниска, като делът на отложеното публикуване на сделките с борсово търгуване фондове е значително по-висок, отколкото при сделките с акции и с други капиталови инструменти. За да може изискването за прозрачност в реално време след сключването на сделка да обхване повече сделки с борсово търгуване фондове е необходимо да се увеличи минималният допустим размер на сделките с борсово търгуване фондове, които имат право на 60-минутно отложено публикуване. С това увеличение на прага се балансира интересът от повишаване на прозрачността в реално време с този от осигуряване на достатъчна защита срещу потенциалните отрицателни последици от показването на нарежданията с голям размер.
- (6) Пазарните участници тълкуват различно изискванията за прозрачност преди сключването на сделка при хибридните системи за търгуване, поради което оповестяванияте от операторите на такива системи сведения в изпълнение на изискванията за прозрачност преди сключването на сделка са различни. Хибридните системи са системи, които съчетават две или повече системи за търгуване. Оповестяванияте от операторите на такива системи сведения в изпълнение на изискванията за прозрачност преди сключването на сделка следва да са едни и същи в целия Съюз, поради което изискванията за прозрачност преди сключването на сделка за дадена хибридна система за търгуване следва да отразяват съответните изисквания за отделните съставляващи я системи.
- (7) Технологичното и пазарното развитие, като например засиленото използване на системи с ускорени процеси, позволява на пазарните участници да предоставят по-бързо информация за сделките. Това прави излишно дълъг предвиденият срок за отлагане до обяд на следващия ден на публикуването на информацията след сключването на сделка за сделките, изпълнени по-малко от 2 часа преди края на деня за търгуване. Своевременното публикуване на информацията след сключването на сделка налага този срок да бъде съкратен до 9 часа сутринта местно време на следващия ден за търгуване.
- (8) Местата на търговия, одобрените механизми за публикуване (ОМП) и инвестиционните посредници не тълкуват еднозначно нито изискванията за прозрачност, отнасящи се до публичното оповестяване на информацията след сключването на сделка, нито информацията, която за целите на изчисленията във връзка с прозрачността трябва да се предоставя на Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП) и на компетентните органи. В резултат на това предоставяните сведения са непълни, неточни или непоследователни. Това ограничава използваемостта им, както и качеството и точността на изхождащите от тях изчисления във връзка с прозрачността. С оглед на последователното прилагане в Съюза на изискванията за прозрачност след сключването на сделка е следователно необходимо да се доуточни съдържанието на исканията за данни и по-специално кои данни местата на търговия, ОМП и доставчиците на консолидирани данни трябва да оповестяват, когато предоставят на ЕОЦКП и компетентните органи референтни и количествени данни.
- (9) Поради това Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 следва да бъде съответно изменен.

- (10) С цел местата на търговия, ОМП и инвестиционните посредници да успеят съответно да приспособят своите системи, някои от въведените с настоящия регламент изменения следва да се прилагат от 1 януари 2024 г. С оглед на правната сигурност и приемствеността при сделките, изпълнени преди 1 януари 2024 г., но публикувани или изменени след тази дата, членове 2, 6 и 13 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 и приложение I към него, както са приложими към 31 декември 2023 г., следва да продължат да се прилагат за тези сделки.
- (11) Настоящият регламент е изготвен въз основа на представения на Комисията от ЕОЦКП проект на регулаторни технически стандарти.
- (12) ЕОЦКП проведе открити обществени консултации по проекта на регулаторни технически стандарти, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи във връзка с тях и поиска становището на създадената с член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета <sup>(4)</sup> Група на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

**Изменения на Делегиран регламент (ЕС) 2017/587**

Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 се изменя, както следва:

- 1) В член 1 се заличават точки 2 и 3;
- 2) Член 2 се изменя, както следва:
  - а) букви г) — и) се заличават;
  - б) добавя се следната буква й):

„й) сделката се числи към изброените в член 2, параграф 5 от Регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (\*) сделки, които не представляват сделка за целите на член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014.

(\*) Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията от 28 юли 2016 г. за допълнение на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за докладването на сделки пред компетентните органи (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 449).“;

- 3) Член 6 се изменя, както следва:
  - а) букви г) — и) се заличават;
  - б) добавя се следната буква к):

„к) сделката се числи към изброените в член 2, параграф 5 от Регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията сделки, които не представляват сделка за целите на член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014.“;

- 4) В член 7 параграф 2 се заменя със следното:

„2. За борсово търгуваните фондове размерът на нареждане се приема за голям, когато е не по-малък от 3 000 000 евро.“;

- 5) В член 13 букви б), в) и г) се заличават;
- 6) В член 15, параграф 3 буква б) се заменя със следното:

„б) за сделките, които не са включени в буква а) – не по-късно от началото на следващия ден на търговия на най-относимия пазар по отношение на ликвидността.“;

<sup>(4)</sup> Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

7) Член 17 се изменя, както следва:

а) параграф 2 се заменя със следното:

„2. Компетентните органи, пазарните оператори и инвестиционните посредници, в т.ч. инвестиционните посредници, организират място на търговия, използват информацията, публикувана в изпълнение на параграф 1 от настоящия член за целите на член 4, параграф 1, букви а) и в) и член 14, параграфи 2 и 4 от Регламент (ЕС) № 600/2014, за периода между първия понеделник от месец април на годината, в която тя е публикувана, и деня преди първия понеделник на месец април следващата година.“;

б) добавят се следните параграфи 6 и 7:

„6. Когато по силата на член 22 от Регламент (ЕС) № 600/2014 ЕОЦКП или компетентните органи изискват информация, местата на търговия, ОМП и ДКД я предоставят в съответствие с приложение IV към настоящия регламент.

7. Когато размерът на сделката, определен за целите на член 7, параграфи 1 и 2, член 8, параграф 2, буква а), член 11, параграф 1 и член 15, параграф 1, е изразен в парична стойност и паричната единица на финансовия инструмент не е евро, размерът на сделката се конвертира в паричната единица на финансовия инструмент по фиксинга на Европейската централна банка към 31 декември предходната година.“;

8) Приложение I се изменя с приложение I към настоящия регламент;

9) Приложение II се изменя с приложение II към настоящия регламент;

10) Приложение III към настоящия регламент се добавя като приложение IV.

## Член 2

### Поправки на Делегиран регламент (ЕС) 2017/587

Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 се поправя, както следва:

1) В член 9 буква б) се заменя със следното:

„б) мярката е подчинена на технически изисквания, равностойни на определените за одобрените механизми за публикуване (ОМП) в член 14 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/571, които улесняват консолидирането на данните със сходни данни от други източници“;

2) Член 18 се заменя със следното:

„Член 18

#### Компетентни органи

(член 22, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 600/2014)

Компетентният орган за даден финансов инструмент, който в изпълнение на членове 4, 7, 11 и 17 прави съответните изчисления и осигурява публикуването на съответната информация, е посоченият в член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014 компетентен орган на най-относимия пазар по отношение на ликвидността, както този пазар е определен в член 16 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590.“.

## Член 3

### Преходна разпоредба

Членове 2, 6 и 13 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 и приложение I към него – както са приложими към 31 декември 2023 г., продължават да се прилагат за сделките, изпълнени преди 1 януари 2024 г.

## Член 4

**Влизане в сила и прилагане**

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Член 1, параграфи 2, 3, 5 и 8 се прилага от 1 януари 2024 г.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 17 януари 2023 година.

За Комисията  
Председател  
Ursula VON DER LEYEN

---

## ПРИЛОЖЕНИЕ I

Приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 се изменя, както следва:

(1) Таблица 1 се заменя със следното:

„Таблица 1

**Описание на вида системи за търгуване и свързаната с тях информация, която по силата на член 3 подлежи на публично оповестяване**

Ред	Вид система за търгуване	Описание на системата за търгуване	Информация, която подлежи на публично оповестяване
1	Система за търгуване с регистър на нарежданията с непрекъснато наддаване	Система, която чрез регистър на нарежданията и търговски алгоритъм функционира без човешка намеса, като непрекъснато свързва нарежданията за продажба с насрещните нареждания за покупка въз основа на най-добрата налична цена.	Общият брой на нарежданията и акциите, депозитарните разписки, борсово търгуваните фондове, сертификатите и други подобни финансови инструменти, които те представляват при всяко ценово равнище, за поне петте най-добри оферти „купува“ и „продава“.
2	Система за търгуване с котировки	Система, при която сделките се сключват на основата на твърди котировки, които се предоставят непрекъснато на участниците, което изисква от маркет мейкърите да поддържат котировки в размер, който балансира потребностите на членовете и участниците да договарят в търговски размери и риска, на който маркет мейкърът излага себе си.	Най-добрата оферта „купува“ и „продава“ на всеки маркет мейкър за акции, депозитарни разписки, борсово търгувани фондове, сертификати и други подобни финансови инструменти, които се търгуват на системата за търгуване, заедно с обемите при тези оферти. Публично оповестени котировки са тези, които представляват обвързващи задължения за покупка и продажба на финансови инструменти и които указват цената и обема на финансовите инструменти, на които регистрираните маркет мейкъри са готови да продават или купуват. При извънредни пазарни условия обаче за ограничен срок може да се разрешат индикативни или едностранни цени.
3	Система за търгуване с периодично наддаване	Система, която свързва нарежданията въз основа на периодично наддаване и търговски алгоритъм, функциониращ без човешка намеса.	Цената, при която системата за търгуване с периодично наддаване би отговорила в максимална степен на търговския си алгоритъм за акциите, депозитарните разписки, борсово търгуваните фондове, сертификатите и други подобни финансови инструменти, които се търгуват на нея, както и обемът, който потенциално би бил изпълним при тази цена от участниците в тази система.

Ред	Вид система за търгуване	Описание на системата за търгуване	Информация, която подлежи на публично оповестяване
4	Система за търгуване със запитване за котировки	Система, където котировките се предоставят в отговор на запитвания за котировки от един или няколко членове или участници. Котировката е изпълнима само от запитващия член или участник. Запитващият член или участник може да сключи сделка, като приеме предоставените на запитването му котировки.	Котировките и свързаните с тях обеми от всеки член или участник, които, ако бъдат приети, биха довели до сделка съгласно правилата на системата. Всички предоставени в отговор на запитване котировки могат да бъдат публикувани едновременно, но не по-късно от момента, в който станат изпълними.
5	Хибридна система за търгуване	Система, попадаща в два или повече от видовете системи за търгуване, посочени в редове 1—4 от настоящата таблица.	За хибридните системи, които съчетават различни системи за търгуване по едно и също време, изискванията са изискванията за прозрачност преди сключването на сделка, приложими за всеки вид система за търгуване в състава на хибридната система. За хибридните системи, които съчетават две или повече системи за търгуване в последователност, изискванията са изискванията за прозрачност преди сключването на сделка, приложими за съответната система за търгуване, управлявана в определен момент.
6	Всяка друга система за търгуване	Всеки друг вид система за търгуване, която не е обхваната от редове 1—5.	Подходяща информация за равнището на нарежданията или котировките и на търговския интерес към акциите, депозитарните разписки, борсово търгуваните фондове, сертификатите и други подобни финансови инструменти, които се търгуват на системата за търгуване; по-специално, петте най-добри оферти „купува“ и „продава“ и/или двустранните котировки на всеки маркет мейкър за този инструмент, ако характеристиките на механизма на определяне на цените позволяват това.“

(2) Таблици 3 и 4 се заменят със следното:

„Таблица 3

**Списък с данни за целите на прозрачността след сключване на сделка**

#	Идентификатор на полето	Описание на информацията, която трябва да се публикува	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 2
1	Дата и час на сделката	<p>Датата и часът на изпълнение на сделката.</p> <p>За сделките, които се изпълняват на място на търговия, степента на подробност се определя от изискванията в член 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574.</p> <p>За сделките, които не се изпълняват на място на търговия — датата и часът, когато страните се договарят за съдържанието на следните полета: количество, цена, валути, както е посочено</p>	<p>Регулиран пазар (РП)</p> <p>Многостранна система за търгуване (МСТ)</p> <p>Одобрен механизъм за публикуване (ОМП)</p> <p>Доставчик на консолидирани данни (ДКД)</p>	{DATE_TIME_FORMAT}

#	Идентификатор на полето	Описание на информацията, която трябва да се публикува	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 2
		<p>в полета 31, 34 и 44 на таблица 2 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590, идентификационен код на инструмента, класификация на инструмента и код на базовия инструмент, когато е приложимо. За сделките, които не се изпълняват на място на търговия, докладваният момент е с разбивка поне до най-близката секунда.</p> <p>Когато сделката се изпълнява по нареждане, предадено от изпълняващото дружество, действащо от името на клиент, на трета страна, без да са изпълнени условията за предаване, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590, се взимат датата и часът на сделката, а не часът на предаване на нареждането.</p>		
2	Идентификационен код на инструмента	Код, използван за идентифициране на финансовия инструмент.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{ISIN}
3	Цена	<p>Цената на изпълнение на сделката, с изключение на комисионата и начислените лихви, ако е приложимо.</p> <p>Когато цената е изразена като парична стойност, тя се представя в основната валута.</p> <p>Ако цената не е налична към дадения момент, но предстои да бъде определена („PNDG“) или не е приложима („NOAP“), това поле не се попълва.</p>	РП, МСТ, ОМП, ДКД	<p>{DECIMAL-18/13} – когато цената е изразена като парична стойност: капиталови и квазикапиталови финансови инструменти</p> <p>{DECIMAL-11/10} – когато цената е изразена като процент или доходност: сертификати и други квазикапиталови финансови инструменти</p>
4	Неналична цена	<p>Когато цената не е налична към дадения момент, но предстои да бъде определена, стойността е „PNDG“.</p> <p>Когато цената не е приложима, се посочва „NOAP“.</p>	РП, МСТ, ОМП, ДКД	<p>„PNDG“ – ако цената не е налична</p> <p>„NOAP“ – ако цената не е приложима</p>
5	Валута на цената	Валута, в която е изразена цената (приложимо, ако цената е изразена като парична стойност).	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{CURRENCYCODE_3}
6	Изражение на цената	Обозначение, указващо дали цената е изразена в парична стойност, като процент или като доходност.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	<p>„MONE“ – парична стойност:</p> <p>капиталови и квазикапиталови финансови инструменти</p> <p>„PERC“ – процент:</p>



#	Идентификатор на полето	Описание на информацията, която трябва да се публикува	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 2
				сертификати и други квазикапиталови финансови инструменти „YIEL“ – доходност: сертификати и други квазикапиталови финансови инструменти „VARO“ – базисни пунктове: сертификати и други квазикапиталови финансови инструменти
7	Количество	Брой на дяловите единици на финансовите инструменти. Номиналната или паричната стойност на финансовия инструмент.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{DECIMAL-18/17} – ако количеството е изразено като брой единици  {DECIMAL-18/5} – ако количеството е изразено като парична или номинална стойност
8	Място на изпълнение	Идентификационният код на мястото на изпълнение на сделката.  За сделките, извършени на място на търговия в ЕС, се използва кодът на съответния пазарен сегмент по ISO 10383 („segment MIC“). Ако няма такъв сегментен код, се използва оперативният ИКП („operating MIC“).  За изпълнените от систематичен участник сделки с допуснати до търгуване или търгувани на място на търговия финансови инструменти се посочва „SINT“.  За тези сделки с допуснати до търгуване или търгувани на място на търговия финансови инструменти, които нито са изпълнени на място на търговия в ЕС, нито са изпълнени от систематичен участник, се посочва „XOFF“. Ако сделката се изпълнява на организирана платформа за търгуване извън ЕС, в допълнение към „XOFF“ се попълва и полето „Място на изпълнение на сделката в трета държава“.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{MIC} – места на търговия в ЕС или „SINT“ – систематичен участник „XOFF“ – в противен случай

#	Идентификатор на полето	Описание на информацията, която трябва да се публикува	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 2
9	Място на изпълнение на сделката в трета държава	Идентификационният код на намиращото се в трета държава място на търговия, където е изпълнена сделката. Използва се кодът на съответния пазарен сегмент по ISO 10383. Ако няма такъв сегментен код, се използва оперативният ИКП.  Полето не се попълва, ако сделката не се изпълнява на намиращо се в трета държава място на търговия.	ОМП, ДКД	{MIC}
10	Дата и час на публикуване	Датата и часът на публикуване на сделката от място на търговия или ОМП.  За сделките, които се изпълняват на място на търговия, степента на подробност се определя от изискванията в член 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574.  За сделките, които не се изпълняват на място на търговия, датата и часът се разбиват поне до най-близката секунда.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Място на публикуване	Код за идентифициране на мястото на търговия или ОМП, които публикуват сделката.	ДКД	Място на търговия: {MIC}  ОМП: 4-знаковият код на съответния пазарен сегмент по ISO 10383, ако е наличен. В противен случай, съответният 4-знаков код от списъка на доставчиците на услуги за докладване на данни, публикуван на уебсайта на ЕОЦКП.
12	Идентификационен код на сделката	Буквено-цифровият код, определен от местата на търговия (по силата на член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията <sup>(1)</sup> ) и ОМП; той се използва при всяко следващо позоваване на дадената сделка.  Идентификационният код на сделката е собствен, последователно използван и постоянен за всеки пазарен сегмент по ISO 10383 и за всеки ден за търгуване. Ако мястото на търговия не използва кодове на пазарен сегмент, определеният идентификационен код на сделката е собствен, последователно използван и постоянен за всеки оперативен ИКП и за всеки ден на търгуване.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{ALPHANUM-52}

#	Идентификатор на полето	Описание на информацията, която трябва да се публикува	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 2
		Ако ОМП не използва ИКП, този ОМП се идентифицира за всеки ден на търгуване със собствен, последователно използван и постоянен 4-знаков код.  Елементите на идентификационния код на дадена сделка не трябва да разкриват самоличността на контрагентите по сделката, на която той е отреден.		

(<sup>1</sup>) Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията от 24 юни 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за съхраняването на съответната информация, свързана с нарежданията относно финансови инструменти (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 193).

Таблица 4

## Списък с обозначения за целите на прозрачността след сключването на сделка

Обозначение	Наименование	Вид място на изпълнение или на публикуване	Описание
„BENC“	Обозначение за сделките, основани на базов критерий	РП, МСТ ОМП ДКД	Сделките, изпълнени на база цена, изчислена за няколко времеви момента според базов критерий – напр. средно-претеглена спрямо обема или спрямо времето.
„NPFT“	Обозначение за неценообразуващите сделки	РП, МСТ ДКД	Неценообразуващите сделки, както са посочени в член 2, параграф 5 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590.
„PORT“	Обозначение за портфейлните трансакции	РП, МСТ ОМП ДКД	Трансакциите с пет или повече различни финансови инструмента, извършвани по едно и също време от един и същ клиент и като една партида срещу дадена референтна цена.
„CONT“	Обозначение за сделките под условие	РП, МСТ ОМП ДКД	Сделките, които зависят от покупката, продажбата, създаването или обратното изкупуване на дериватен договор или друг финансов инструмент, като всички компоненти на трансакцията са предназначени да бъдат изпълнени като една партида.
„ACTX“	Обозначение за сделките от вида „agency cross“	ОМП ДКД	Сделките, при които инвестиционният посредник е обединил нареждания на клиенти и извършва покупко-продажбата като една операция с едни и същи обем и цена.
„SDIV“	Обозначение за специалните сделки с дивидент	РП, МСТ ОМП ДКД	Сделките, които: са изпълнени след откъсването на купона, но дивидентът или всяка друга форма на разпределение на печалбата отива при купувача, а не при продавача; или са изпълнени преди откъсването на купона, но дивидентът или всяка друга форма на разпределение на печалбата отива при продавача, а не при купувача.

Обозначение	Наименование	Вид място на изпълнение или на публикуване	Описание
„LRGS“	Обозначение за сключена сделка с голям размер	РП, МСТ ОМП ДКД	Сделките с голям размер спрямо обичайния пазарен размер, за които член 15 разрешава отложено публикуване.
„RFPT“	Обозначение за сделките според референтна цена	РП, МСТ ДКД	Сделките, които се изпълняват от системите, функциониращи в съответствие с член 4, параграф 1, буква а) от Регламент (ЕС) № 600/2014.
„NLIQ“	Обозначение за договорена сделка с ликвидни финансови инструменти	РП, МСТ ДКД	Сделките, изпълнени в съответствие с член 4, параграф 1, буква б), подточка i) от Регламент (ЕС) № 600/2014.
„OILQ“	Обозначение за договорените сделки с неликвидни финансови инструменти	РП, МСТ ДКД	Сделките, изпълнени в съответствие с член 4, параграф 1, буква б), подточка ii) от Регламент (ЕС) № 600/2014.
„PRIC“	Обозначение за договорените сделки, които подлежат на условия, различни от текущата пазарна цена	РП, МСТ ДКД	Сделките, изпълнени в съответствие с член 4, параграф 1, буква б), подточка iii) от Регламент (ЕС) № 600/2014, както са определени в член 6.
„ALGO“	Обозначение за алгоритмичните сделки	РП, МСТ ДКД	Сделките, изпълнени в резултат на извършвана от инвестиционен посредник алгоритмична търговия, както е определена в член 4, параграф 1, точка 39 от Директива 2014/65/ЕС.
„SIZE“	Обозначение за сделките над стандартния пазарен размер	ОМП ДКД	Сделките, които се изпълняват от систематичен участник, когато размерът на входящото нареждане е над стандартния пазарен размер по член 11.
„ILQD“	Обозначение за сделките с неликвидни инструменти	ОМП ДКД	Сделките с неликвидни инструменти, както са определени в съответствие с членове 1—5 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/567 на Комисията <sup>(1)</sup> , изпълнени от систематичен участник.
„RPRI“	Обозначение за сделките, получили по-добра цена	ОМП ДКД	Изпълнените от систематичен участник сделки на по-добра цена в съответствие с член 15, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 600/2014.
„CANC“	Обозначение за анулиране	РП, МСТ ОМП ДКД	Когато вече публикувана сделка е анулирана.
„AMND“	Обозначение за изменение	РП, МСТ ОМП ДКД	При изменение на публикувана по-рано сделка
„DUPL“	Обозначение за дублираща се информация за сделка	ОМП	Когато сделка се докладва на повече от един ОМП в съответствие с член 16, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/571.

(<sup>1</sup>) Делегиран регламент (ЕС) 2017/567 на Комисията от 18 май 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на определенията, прозрачността, компресирането на портфейл и надзорните мерки за намеса по отношение на продукти и управление на позиции (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 90).“

## ПРИЛОЖЕНИЕ II

В приложение II към Делегиран регламент (ЕС) 2017/587 таблица 5 се заменя със следното:

„Таблица 5

**Прагове за отложено публикуване и отсрочки — борсово търгувани фондове**

Минимален допустим за отложено публикуване размер на сделка (в евро)	Момент на публикуване след сключването на сделката
15 000 000	60 минути
50 000 000	в края на деня на търгуване“

## ПРИЛОЖЕНИЕ III

## „ПРИЛОЖЕНИЕ IV

**Необходими сведения с цел определяне на най-относитимия пазар по отношение на ликвидността, СДО и ССС**

Таблица 1

Таблица със символи

Символ	Вид данни	Определение
{ALPHANUM-n}	До n буквено-цифрови символа	Поле за свободен текст
{ISIN}	12 буквено-цифрови символа	ISIN код по ISO 6166
{MIC}	4 буквено-цифрови символа	Идентификационен код на пазара по ISO 10383
{DATEFORMAT}	Формат за датата по ISO 8601	Датите се попълват в следния формат: ГГГГ-ММ-ДД.
{DECIMAL-n/m}	Десетично число с общо до n цифри, от които до m цифри могат да бъдат цифри след десетичната запетая	Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни стойности. Десетичният разделител е „.“ (запетая); пред отрицателните стойности се поставя „-“ (минус); стойностите се закръгляват и не се съкращават.
{INTEGER-n}	Цяло число с до n цифри	Цифрово поле за положителни и отрицателни цели числа.

Таблица 2

**Необходими сведения с цел определяне на най-относитимия пазар по отношение на ликвидността, СДО и ССС (въз основа на настоящите указания във връзка с докладването)**

№	Идентификатор на полето	Описание на подлежащите на публикуване сведения	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 1
1	Идентификационен код на инструмента	Код, използван за идентифициране на финансовия инструмент	Регулиран пазар (РП) Многостранна система за търгуване (МСТ) Одобрен механизъм за публикуване (ОМП) Доставчик на консолидирани данни (ДКД)	{ISIN}
2	Дата на изпълнение	Датата на изпълнение на сделките.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{DATEFORMAT}

№	Идентификатор на полето	Описание на подлежащите на публикуване сведения	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 1
3	Място на изпълнение	Пазарният сегмент на мястото на търговия от ЕС или на систематичния участник, ако има такъв, в противен случай — оперативният ИКП.  „XOFF“, ако сделката не се изпълнява на място на търговия, а от инвестиционни посредници, които не са систематични участници.	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{MIC} – на мястото на търговия или систематичния участник, или {MIC} „XOFF“
4	Обозначение за спиране на даден инструмент	Обозначение за това дали инструментът е спрял за целия ден на търгуване на съответното място на търговия на датата на изпълнение.  В резултат на спирането на инструмента за целия ден на търгуване, полета 5—10 се попълват със стойност нула.	РП, МСТ, ДКД	TRUE – ако инструментът е спрял за целия ден на търгуване  или FALSE – ако инструментът не е спрял за целия ден на търгуване
5	Общ брой сделки	Общият брой сделки, изпълнени на датата на изпълнение (**).	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{INTEGER-18}
6	Общ оборот	Общият оборот, изпълнен на датата на изпълнение, изразен в евро (*) (**).	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{DECIMAL-18/5}
7	Изпълнени сделки, без изпълнените при предвидените в член 4, параграф 1, букви а), б) и в) от Регламент (ЕС) № 600/2014 освобождавания преди сключването на сделка	Общият брой сделки, изпълнени на датата на изпълнение, без сделките, изпълнени същия ден при предвидените в член 4, параграф 1, букви а), б) и в) от Регламент (ЕС) № 600/2014 освобождавания преди сключването на сделка (**).	РП, МСТ, ДКД	{INTEGER-18}
8	Общ изпълнен оборот, без сделките, изпълнени при предвидените в член 4, параграф 1, букви а), б) и в) от Регламент (ЕС) № 600/2014 освобождавания преди сключването на сделка	Общият изпълнен на датата на изпълнение оборот, без сделките, изпълнени същия ден при предвидените в член 4, параграф 1, букви а), б) и в) от Регламент (ЕС) № 600/2014 освобождавания преди сключването на сделка (*) (**).	РП, МСТ, ДКД	{DECIMAL-18/5}

№	Идентификатор на полето	Описание на подлежащите на публикуване сведения	Вид място на изпълнение или на публикуване	Използва се форматът, определен в таблица 1
9	Общ брой сделки, без изпълнените с отложено публикуване на изпълнението им поради големия им размер	<p>Общият брой сделки, изпълнени на датата на изпълнение, без тези, чийто голям размер ги включва в обхвата на освобождаването след сключването на сделка (**).</p> <p>За установяването на сделките с акции и депозитарни разписки се използва само най-високият праг за съответния интервал на среднодневния оборот (СДО) в таблица 4 от приложение II.</p> <p>За установяването на сделките със сертификати и други подобни финансови инструменти се използва само най-високият праг в таблица 6 от приложение II.</p> <p>За установяването на сделките с борсово търгувани фондове се използва само най-високият праг в таблица 5 от приложение II.</p>	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{INTEGER-18}
10	Общ изпълнен оборот, без изпълнените сделки с отложено публикуване на изпълнението поради големия им размер.	<p>Общият обем сделки, изпълнени на датата на изпълнение, без тези, чийто голям размер ги включва в обхвата на освобождаването след сключването на сделка (*) (**).</p> <p>За установяването на сделките с акции и депозитарни разписки се използва само най-високият праг за съответния интервал на среднодневния оборот (СДО) в таблица 4 от приложение II.</p> <p>За установяването на сделките със сертификати и други подобни финансови инструменти се използва само най-високият праг в таблица 6 от приложение II.</p> <p>За установяването на сделките с борсово търгувани фондове се използва само най-високият праг в таблица 5 от приложение II.</p>	РП, МСТ, ОМП, ДКД	{DECIMAL-18/5}

(\*) Оборътът се изчислява, като броят на инструментите, обменени между купувачите и продавачите, се умножи по единичната цена на обменения в дадената сделка инструмент. Оборътът се изразява в евро.

(\*\*) Докладваните данни не включват анулираните сделки.

Полето се попълва във всички случаи, като отбелязаната стойност е по-голяма или равна на нула и съдържа до 18 цифри, от които – до 5 след десетичната запетая.“