

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/575,**8. juuni 2016,****millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad täitmiskohtade poolt tehingute täitmise kvaliteedi kohta avaldatavat teavet****(EMPs kohaldatav tekst)**

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiivi 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL, ⁽¹⁾ eriti selle artikli 27 lõike 10 esimese lõigu punkti a,

ning arvestades järgmist:

- (1) Selleks et pakkuda nii avalikkusele kui ka investeerimisühingutele korralduste täitmise kvaliteedi kohta asjakohaseid andmeid, et aidata neil määrata kindlaks parim viis kliendi korralduste täitmiseks, on oluline sätestada selliste finantsinstrumentide puhul, mille suhtes kehtib Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 600/2014 ⁽²⁾ artiklite 23 ja 28 kohane kohustusliku kauplemissüsteemi nõue, täitmise kvaliteediga seotud ning kauplemissüsteemide ja kliendi korralduste süsteemsete täitjate avaldatavate andmete konkreetne sisu, vorming ja esitamise sagedus. Muude finantsinstrumentide puhul, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemissüsteemi nõue, on samuti oluline sätestada täitmise kvaliteediga seotud ning täitmiskohtade avaldatavate andmete konkreetne sisu, vorming ja esitamise sagedus. Sellega seoses tuleb asjakohaselt arvesse võtta täitmiskoha ja asjaomase finantsinstrumenti liiki.
- (2) Selleks et täielikult hinnata liidus tehtavate tehingute täitmise kvaliteedi taset, on asjakohane, et täitmiskohad, mille investeerimisühingud võivad kliendi korralduste täitmiseks välja valida, täidavad nõudeid selliste andmete kohta, mida täitmiskohad peavad kooskõlas käesoleva määrusega esitama. Seetõttu peaksid täitmiskohad hõlmama reguleeritud turge, mitmepoolseid kauplemissüsteeme, organiseeritud kauplemissüsteeme, kliendi korralduste süsteemsete täitjaid, turutegijaid ja muid likviidsuse pakkujaid.
- (3) Täitmiskoha ja finantsinstrumentide liikide erinevustest tulenevalt peaks aruannete sisu olema erinev, sõltudes mitmest tegurist. Selleks et paigutada täitmise kvaliteet õigesse konteksti, on asjakohane, et esitatud andmete hulk ja laad oleksid eri kauplemissüsteemide, -režiimide ja -platvormide puhul erinevad.
- (4) Selleks et vältida täitmiskohtade sobimatut võrdlemist ja tagada kogutud andmete asjakohasus, peaksid täitmiskohad esitama eraldi aruanded, mis vastavad segmentidele, mille puhul on erinevad tellimusraamatud või mida reguleeritakse erinevalt või mis kasutavad erinevaid turusegmentide tunnuseid.
- (5) Tagamaks tegelikult toimunud täitmise kvaliteedist õige ülevaate, ei tohiks kauplemissüsteemid avaldada täidetud korralduste hulgas neid, millelega kaubeldi börsiväliselt ja mis esitati kauplemissüsteemile.
- (6) Kui turutegijad ja muud likviidsuse pakkujad esitavad aruande selliste finantsinstrumentide täitmise kohana, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemissüsteemi nõue, peaksid nad avaldama teabe oma klientide täidetud korralduste või neile pakutud hindade kohta ainult juhul, kui korraldused on näidatud või täidetud börsiväliselt või täidetud vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 4 ja 9, välja arvatud kauplemissüsteemi korralduste haldamise süsteemis hoitavad ja avaldamist ootavad korraldused.
- (7) On asjakohane võtta arvesse, et muude likviidsuse pakkujate hulgas peaksid olema ettevõtjad, kes näitavad, et nad on valmis kaupleva oma arvel, ja kes pakuvad likviidsust oma tavapärase äritegevuse osana, olenemata sellest, kas neil on ametlikud kokkulepped või kas nad on võtnud kohustuse pakkuda likviidsust pidevalt.

⁽¹⁾ ELT L 173, 12.6.2014, lk 349.

⁽²⁾ Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrus (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 (ELT L 173, 12.6.2014, lk 84).

- (8) Selleks et saavutada tehingute täitmise kvaliteedi täielik läbipaistvus seoses hindadega, on asjakohane, et hindade kohta esitatav teave ei hõlmaks ühtki vahendustasu ega kogunenud intresse, kui see on asjakohane.
- (9) Hindade kvaliteedi hindamiseks asjakohase teabe kindlaksmääramiseks tuleks nõuda nii päeva keskmiseid tasemeid kui ka kindla ajahetke andmeid. See annab osalejatele täitmise kvaliteedi analüüsimisel asjakohase konteksti ja täielikuma ülevaate. Selleks et finantsinstrumentide hindu oleks võimalik võrrelda, on vaja kajastatud tehingute puhul märkida ka valuutakoodid.
- (10) Tagamaks regulatiivse kooskõla, ei ole asjakohane nõuda, et kauplemiskohad esitaksid selliste tehingute üksikasju, mille avalikustamisega on kooskõlas kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuetega lubatud avaldamise ajal veel viivitada. On asjakohane, et kliendi korralduste süsteemsed täitjad, turutegijad ja muud likviidsuse pakkujad oleksid vabastatud kindla ajahetke tehinguandmete avaldamisest, kui tegemist on turu tavamahtu ületavate tehingutega või tehingutega, mis ületavad konkreetsele finantsinstrumendile omast mahtu, selleks et vältida, et neil tekib tarbetu, tundliku äriteabe avalikustamise risk, mis võib kahjustada nende riskipositsioonide maandamise ja likviidsuse pakkumise võimet. Määruse (EL) nr 600/2014 alusel mittelikviidsetena käsitatavate aktsiate, börsil kaubeldavate fondide ja sertifikaatide korral on kasutatav turu tavamahu piirmäär sellist liiki finantsinstrumendi väikseim võimalik turu tavamaht. Ebakindluse vältimiseks on asjakohane selgitada, et terminite „suuremahuline“ ja „finantsinstrumendile omane maht“ tähendus on sama, mis sätestatud kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuetes.
- (11) Kõigi teatud täitmiskoha kaudu täidetavate korralduste täitmisel võetavate tasude täielik läbipaistvus on äärmiselt oluline. On vaja täpsustada kõik kliendi korralduse täitmise kulud, mis on seotud konkreetse koha kasutamisega ja mille eest klient otseselt või kaudselt tasub. Need kulud peaksid hõlmama täitmistasusid, sealhulgas korralduste esitamise, muutmise või tühistamise või hinnapakkumiste tühistamise tasud, samuti turuandmetele juurdepääsu või terminalide kasutamisega seotud võimalikud tasud. Asjaomased kulud võivad hõlmata ka kliiringu- või arveldustasusid või muid tasusid, mis makstakse korralduse täitmisesse kaasatud kolmandatele isikutele, kui nad on seotud täitmiskoha osutatud teenustega. Teave kulude kohta peaks hõlmama ka makse, mille kohta esitatakse arve otse täitmiskohale või mille täitmiskoht tasub täitmiskoha liikmete või kasutajate või korraldusega seotud kliendi eest.
- (12) Täitmise tõenäosus viitab teatud liiki korralduse täitmise tõenäosusele ja seda toetavad teatud instrumendiga kauplemise mahtude andmed või korralduste ja tehingute muud üksikasjad. Täitmise tõenäosust käsitlev teave peaks võimaldama arvutada selliseid näitajaid nagu näiteks täitmiskoha suhteline turusuurus teatava finantsinstrumendi või finantsinstrumentide klassi puhul. Täitmise tõenäosuse hindamisel tuleks vaadelda ka luhtunud tehingute või tühistatud või muudetud korralduste andmeid.
- (13) Täitmise kiirusel võib eri täitmiskohtade jaoks olla erinev tähendus, kuna kiiruse mõõtmine on nii kauplemis-süsteemi kui ka kauplemisplatvormi erinev. Tellimusraamatupõhise kestevoksioni kauplemissüsteemi korral peaks täitmise kiirust väljendama millisekundites, muude kauplemissüsteemide puhul on asjakohane kasutada suuremaid ajahühikuid. Lisaks on asjakohane mitte võtta arvesse latentsusaega konkreetse osalise ühenduse puhul täitmiskohaga, kuna see on täitmiskoha kontrolli alt väljas.
- (14) Selleks et võrrelda erineva suurusega korralduste täitmise kvaliteeti, peaksid täitmiskohad olema kohustatud esitama aruandeid tehingute kohta mitme suurusevahemiku kaupa. Nende vahemike piirid peaksid olenema finantsinstrumendi liigist ja likviidsusest, et tagada täitmiste asjakohane valim asjaomase instrumendi tüüpilise suuruse puhul.
- (15) On oluline, et täitmiskohad koguksid andmeid kogu tavapärase tööaja jooksul. Aruanne tuleks seepärast esitada tasuta masinloetavas elektroonilises vormingus Internetis, et võimaldada avalikkusel kõik esitatud andmed alla laadida, neid otsida, sortida ja analüüsida.
- (16) Täitmiskohtade kaupa esitatud aruandeid peaksid täiendama direktiivi 2014/65/EL kohaselt asutatud kauplemis-koondteabe pakkuja andmed, mis võimaldaks töötada välja tõhusamad täitmiskvaliteeti käsitlevad meetmed.

- (17) Kooskõla ja finantsturgude sujuva toimimise tagamiseks on vaja, et käesoleva määruse sätteid ning direktiivi 2014/65/EL ja määruse (EL) nr 600/2014 sätteid hakataks kohaldama samast kuupäevast.
- (18) Käesolev määrus põhineb regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul, mille on komisjonile esitanud Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve (ESMA).
- (19) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud võimalikku asjaomast kulu ja tulu ning küsinud arvamust Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ⁽¹⁾ artikli 37 kohaselt loodud väärtpaberituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Reguleerimise

Käesolevas määruses on sätestatud tehingute täitmise kvaliteediga seotud selliste andmete konkreetne sisu, vorming ja avaldamise sagedus, mida täitmiskohad peavad avaldama. Seda kohaldatakse kauplemiskohtade, kliendi korralduste süsteemsete täitjate, turutegijate või muude likviidsuse pakkujate suhtes.

Artikkel 2

Mõisted

Käesolevas määruses kasutatakse järgmisi mõisteid:

- a) „kauplemissüsteem“ – viis, kuidas täitmiskoht täidab korraldusi tellimusraamatupõhise kestevoksjoni või kestval noteeringute andmisel põhineva kauplemissüsteemina, hinnapäringusüsteemina, perioodioksjonipõhise kauplemissüsteemina või mis tahes hübriidsüsteemina, mis kuulub kahte või enamasse kõnealusesse kategooriasse või selliste süsteemide alla, mille puhul on hindade kindlaksmääramise protsess eespool nimetatud süsteemide liikide omast olemuselt erinev;
- b) „finantsinstrumendile omane maht“ – sellisele kauplemiskohas kaubeldavale võlakirjale, struktureeritud finantstootele, lubatud heitkoguste väärtpaberile või tuletisinstrumendile omane maht, millel puudub likviidne turg ja millega tehtavate tehingute puhul on lubatud avaldamisega viivitamine kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikliga 11;
- c) „suuremahuline“ – määruse (EL) nr 600/2014 artiklite 7 ja 11 kohaselt suuremahuline korraldus;
- d) „luhtunud tehing“ – täitmiskoha poolt tühistatud tehing;
- e) „hinnakordaja“ – ühe tuletislepinguga seotud alusvaraks oleva finantsinstrumendi ühikute arv;
- f) „hinnaühik“ – märges selle kohta, kas tehingu hind on väljendatud rahas, protsentides või väljendab seda tootlus;
- g) „koguseühik“ – märges selle kohta, kas tehingu kogust väljendab ühikute arv, nominaalväärtus või rahaline väärtus;
- h) „ülekande liik“ – märges selle kohta, kas finantsinstrumendi arveldamine toimub füüsiliselt või rahas, sealhulgas juhul, kui vastaspoolel on valikuvõimalus või kui selle määrab kindlaks kolmas isik;
- i) „kauplemisrežiim“ – kavandatud ava-, sulgemis- või päevasisene oksjon, kavandamata oksjon, kauplemine päeva lõpus või väljaspool peamist kauplemisperioodi või kauplemise kohta aruandmine;
- j) „kauplemisplatvorm“ – täitmiskoha hallatava platvormi liik: elektrooniline, hääлкаuplemisplatvorm või suuline kauplemisplatvorm;

⁽¹⁾ Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

- k) „tellimusraamatu sügavus“ – kogu olemasolev likviidsus, mida väljendab kõigi ostu- ja müügipakkumiste hinna ja mahu korrutis kindlaks määratud arvu hinnalisandite puhul alates parima ostu- ja müügipakkumise keskpunktist;
- l) „keskmine efektiivne hinnavahe“ – tegeliku täitmishinna ning laekumise hetkel parima ostu- ja müügipakkumise keskpunkti kahega korrutatud erinevuse keskmine turukorralduste ja turustatavate määratud hinnaga korralduste puhul;
- m) „muutmata passiivsete korralduste täitmise keskmine kiirus parima ostu- ja müügipakkumise puhul“ – keskmine kulunud aeg alates sellise määratud hinnaga korralduse tegemisest, mis vastab täitmiskoha saadavale parimale ostu- ja müügipakkumisele, selle korralduse täitmiseni;
- n) „aktiivne korraldus“ – tellimusraamatusse kantud korraldus, mis vähendas likviidsust;
- o) „passiivne korraldus“ – tellimusraamatusse kantud korraldus, mis lisas likviidsust;
- p) „täida-kohe-või-tühista-korraldus“ (*immediate or cancel order*) – korraldus, mis täidetakse tellimusraamatusse kandmisel ja mis ei jää tellimusraamatusse järelejäänud täitmata mahus;
- q) „täida-või-tühista-korraldus“ (*fill or kill order*) – korraldus, mis täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tingimusel et seda on võimalik täielikult täita. Kui korraldust on võimalik täita ainult osaliselt, lükatakse see automaatselt tagasi ja seda ei täideta.

Artikkel 3

Täitmiskoha ja finantsinstrumendi kohta teabe avaldamine

1. Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, teabe täitmiskoha liigi kohta kooskõlas kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, teabe täitmiskoha liigi kohta kooskõlas kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 1 sätestatud vormingus:

- i) täitmiskoha nimi ja tunnus;
- ii) pädeva asutuse asukohariik;
- iii) turusegmendi nimi ja tunnus;
- iv) kauplemispäeva kuupäev;
- v) koha tavapärasel kauplemisperioodil toimunud selliste katkestuste laad, arv ja keskmine kestus, mis takistasid kõigi selles kohas kauplemiseks kättesaadavate instrumentidega kauplemist kauplemispäeva seisuga;
- vi) koha tavapärasel kauplemisperioodil kavandatud oksjonite laad, arv ja keskmine kestus kauplemispäeva seisuga;
- vii) luhtunud tehingute arv kauplemispäeva seisuga;
- viii) luhtunud tehingute väärtus, väljendatuna protsentides kauplemispäeval täidetud tehingute koguväärtusest.

2. Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, teabe finantsinstrumendi liigi kohta kooskõlas kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, teabe finantsinstrumendi liigi kohta kooskõlas käesoleva lõike kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 2 sätestatud vormingus:

- a) kui finantsinstrumendil on lisa tabeli 2 kohane tunnus:
 - i) nimi ja finantsinstrumendi tunnus;
 - ii) instrumendi liik;
 - iii) valuuta;
- b) kui finantsinstrumendil ei ole lisa tabeli 2 kohast tunnust:
 - i) instrumendi nimi ja kirjalik kirjeldus, sealhulgas alusvaraks oleva instrumendi valuuta, hinnakordaja, hinnaühik, koguseühik ja ülekande liik;
 - ii) instrumendi liik;
 - iii) valuuta.

Artikkel 4

Hind

Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, kooskõlas käesoleva artikli kolmanda ja neljanda lõiguga teabe hinna kohta igal kauplemispäeval, mil täideti finantsinstrumendiga seotud korraldusi.

Täitmiskohad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, kooskõlas käesoleva artikli kolmanda ja neljanda lõiguga teabe hinna kohta igal kauplemispäeval, mil täideti finantsinstrumendiga seotud korraldusi.

Avaldatakse järgmine teave:

- a) päevasisene teave
 - i) kauplemiskohtade puhul kõigi selliste tehingute lihtne keskmine hind iga artikli 9 kohase suurusevahemiku puhul, mis täideti asjaomasel kaupäeval kahe minuti jooksul alates järgmistest kellaaegadest: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 ja 15.30.00 (koordineeritud maailmaaeg);
 - ii) kliendi korralduste süsteemsete täitjate, turutegijate ja muude likviidsuse pakkujate puhul kõigi selliste tehingute lihtne keskmine hind artikli 9 kohase 1. suurusevahemiku puhul, mis täideti asjaomasel kaupäeval kahe minuti jooksul alates järgmistest kellaaegadest: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 ja 15.30.00 (koordineeritud maailmaaeg);
 - iii) punktides i ja ii osutatud kaheminutiliste ajavahemike jooksul täidetud tehingute koguväärtus;
 - iv) kauplemiskohtade puhul, juhul kui punktis i osutatud ajavahemike esimese kahe minuti jooksul tehinguid ei toimunud, iga artikli 9 kohase suurusevahemiku sellise esimese tehingu hind, mis tehti asjaomasel kaupäeval pärast igat punktis i osutatud kellaaega, kui selliseid tehinguid on;
 - v) kliendi korralduste süsteemsete täitjate, turutegijate ja muude likviidsuse pakkujate puhul, juhul kui punktis ii osutatud ajavahemike esimese kahe minuti jooksul tehinguid ei toimunud, artikli 9 kohase 1. suurusevahemiku sellise esimese tehingu hind, mis tehti asjaomasel kaupäeval pärast igat punktis ii osutatud kellaaega, kui selliseid tehinguid on;
 - vi) iga punktides iv ja v osutatud tehingu täitmise aeg;
 - vii) iga punktides iv ja v osutatud tehingu maht, st väärtus;
 - viii) kauplemissüsteem ja -režiim, mille raames punktides iv ja v osutatud tehingud täideti;
 - ix) kauplemisplatvorm, millel punktides iv ja v osutatud tehingud täideti;
 - x) parim ostu- ja müügipakkumine või sobiv võrdlushind täitmise ajal iga punktides iv ja v osutatud täidetud tehingu puhul.

Päevasisene teave avaldatakse lisa tabelis 3 sätestatud vormingus:

b) päevane teave:

- i) lihtne keskmine ja mahuga kaalutud keskmine tehinguhind, juhul kui tehti üle ühe tehingu;
- ii) suurim täitmishind, juhul kui tehti üle kahe tehingu;
- iii) väikseim täitmishind, juhul kui tehti üle kahe tehingu.

Päevane teave avaldatakse lisa tabelis 4 sätestatud vormingus.

Artikkel 5

Kulud

Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, kooskõlas käesoleva artikli kolmanda lõiguga teabe tasude kohta, mida kauplemiskoht kohaldas kauplemiskoha liikmete või kasutajate suhtes.

Täitmiskohad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, kooskõlas käesoleva artikli kolmanda lõiguga teabe tasude kohta, mida täitmiskoht kohaldas täitmiskoha liikmete või kasutajate suhtes.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 5 sätestatud vormingus:

- a) kõigi täitmiskoha kohaldatavate tasude (enne hinnavähendusi ja allahindlusi) komponentide laadi ja suuruse kirjeldus ning teave nende erinevuste kohta eri kasutajate või finantsinstrumentide puhul, ja erinevuste summa. Tasude komponendid hõlmavad järgmist:
 - i) täitmistasud;
 - ii) korralduste esitamise, muutmise või tühistamise või hinnapakumiste tühistamise tasud;
 - iii) turuandmetele juurdepääsuga või terminalide kasutamisega seotud tasud;
 - iv) kliiringu- ja arveldustasud ja muud tasud, mis makstakse korralduse täitmisesse kaasatud kolmandatele isikutele;
- b) täitmiskoha kasutajatele pakutavate hinnavähenduste, allahindluste või muude maksete laadi ja suuruse kirjeldus, sealhulgas teave selle kohta, kuidas need hinnavähendused, allahindlused või muud maksed erinevad eri kasutajate või finantsinstrumentide lõikes, ja erinevuste summa;
- c) täitmiskoha kasutajatele pakutavate mitterahaliste hüvede laadi ja suuruse kirjeldus, sealhulgas teave selle kohta, kuidas need mitterahalised hüved erinevad eri kasutajate või finantsinstrumentide lõikes, ja erinevuste väärtus.
- d) selliste maksude laadi ja suuruse kirjeldus, mille kohta esitatakse arve otse täitmiskohale või mille täitmiskoht tasub täitmiskoha liikmete või kasutajate eest;
- e) täitmiskoha või muu allika veebisaidi link, kust võib leida kulude kohta lisateavet;
- f) kõigi punktide b ja c kohaste hinnavähenduste, allahindluste, mitterahaliste hüvede või muude maksete koguväärtus, väljendatuna protsentides tehingute koguväärtusest aruandeperioodil;
- g) kõigi punkti a kohaste kulude koguväärtus, v.a punktide b ja c kohaste hinnavähenduste, allahindluste, mitterahaliste hüvede või muude maksete koguväärtus, väljendatuna protsentides tehingute koguväärtusest aruandeperioodil.

Artikkel 6

Täitmise tõenäosus

Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva puhul teabe täitmise tõenäosuse kohta kooskõlas käesoleva artikli kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva puhul teabe täitmise tõenäosuse kohta kooskõlas käesoleva artikli kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 6 sätestatud vormingus:

- a) saadud korralduste või hinnapäringute arv;
- b) täidetud tehingute arv ja väärtus, kui tehinguid oli rohkem kui üks;
- c) saadud, kuid tühistatud korralduste või hinnapäringute arv, v.a passiivsed korraldused koos juhustega, mille kohaselt pidid need aeguma või tuli need tühistada päeva lõpus;
- d) saadud, kuid samal kuupäeval muudetud korralduste või hinnapäringute arv;
- e) tehingute mediaansuurus asjaomasel kuupäeval, kui tehinguid oli rohkem kui üks;
- f) kõigi korralduste või hinnapäringute mediaansuurus asjaomasel kuupäeval, kui saadi rohkem kui üks korraldus või hinnapäring;
- g) määratud turutegijate arv.

Artikkel 7

Lisateave tellimusraamatupõhist kestevoksjoni kauplemissüsteemi ja kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi kasutavate täitmiskohtade puhul

1. Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad, kes kasutavad tellimusraamatupõhist kestevoksjoni kauplemissüsteemi, kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta artikli 4 punkti a alapunktides i ja ii täpsustatud kellaaegadel lisateabe kooskõlas käesoleva lõike kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad, kes kasutavad tellimusraamatupõhist kestevoksjoni kauplemissüsteemi, kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta artikli 4 punkti a alapunktides i ja ii täpsustatud kellaaegadel lisateabe kooskõlas käesoleva lõike kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 7 sätestatud vormingus:

- i) parima ostu- ja müügipakkumise hind ja vastavad mahud;
- ii) tellimusraamatu sügavus kolme hinnalisandi puhul.

2. Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad, kes kasutavad tellimusraamatupõhist kestevoksjoni kauplemissüsteemi, kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta lisateabe kooskõlas käesoleva lõike kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad, kes kasutavad tellimusraamatupõhist kestevoksjoni kauplemissüsteemi, kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta lisateabe kooskõlas käesoleva lõike kolmanda lõiguga..

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 8 sätestatud vormingus:

- a) keskmine efektiivne hinnavahe;
- b) keskmine maht parima ostu- ja müügipakkumise puhul;
- c) keskmine hinnavahe parima ostu- ja müügipakkumise puhul;
- d) tühistamiste arv parima ostu- ja müügipakkumise puhul;
- e) muudatuste arv parima ostu- ja müügipakkumise puhul;
- f) tellimusraamatu keskmine sügavus kolme hinnalisandi puhul;

- g) selline keskmine aeg ja mediaanaeg, mis kulus aktiivse korralduse või noteeringu vastuvõtmise kättesaamisest täitmiskoha poolt sellele järgneva täieliku või osalise täitmiseni;
- h) muutmata passiivsete korralduste täitmise keskmine kiirus parima ostu- ja müügipakkumise puhul;
- i) luhtunud täida-või-tühista-korralduste arv;
- j) täiesti täitmata täida-kohe-või-tühista-korralduste arv;
- k) kauplemiskohas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 või 9 kohaselt täidetud suuremahuliste tehingute arv ja väärtus;
- l) kauplemiskohas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 või 9 kohaselt täidetud tehingute arv ja väärtus, v.a kauplemiskoha korralduste haldamise süsteemis hoitavad ja avaldamist ootavad punkti k all kajastamata korraldused;
- m) kauplemiskoha tavapärasel tööajal toimunud volatiilsusest või voolukatkestusest tingitud kauplemiskatkestuste arv ja keskmine kestus;
- n) kauplemiskoha tavapärasel tööajal kauplemiskoha otsuse tõttu toimunud kauplemise peatamiste laad, arv ja keskmine kestus, v.a need, mis kajastati artikli 3 lõike 1 punkti v kohaselt.

3. Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad, kes kasutavad täielikult või osaliselt kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, lisateabe koostöös kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad, kes kasutavad täielikult või osaliselt kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, lisateabe koostöös kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 8 sätestatud vormingus:

- a) iga kauplemispäeva puhul selliste perioodide arv ja keskmine kestus koha tavapärasel tööajal, mis kehtsid üle 15 minuti ja mille ajal ostu- või müügipakkumisi ei esitatud;
- b) noteeringute keskmine esinemine, väljendatuna protsentides koha tavapärasest kauplemisperioodist asjaomasel kaupäeval.

Artikkel 8

Lisateave hinnapäringusüsteemi kasutavate täitmiskohtade puhul

Kauplemiskohad ja kliendi korralduste süsteemsed täitjad, kes kasutavad hinnapäringusüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes kehtib kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta lisateabe koostöös käesoleva artikli kolmanda lõiguga.

Täitmiskohad, kes kasutavad hinnapäringusüsteemi või muud kauplemissüsteemi, mille kohta on kõnealune teave kättesaadav, avaldavad oma iga turusegmendi kohta ja iga sellise finantsinstrumendi kohta, mille suhtes ei kehti kohustusliku kauplemiskoha nõue vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklitele 23 ja 28, iga kauplemispäeva kohta lisateabe koostöös käesoleva artikli kolmanda lõiguga.

Järgmine teave avaldatakse lisa tabelis 9 sätestatud vormingus:

- a) keskmine aeg ja mediaanaeg, mis kulus hinnapakkumise vastuvõtmisest täitmiseni kõigi asjaomase finantsinstrumendiga tehtud tehingute puhul, ning
- b) keskmine aeg ja mediaanaeg, mis kulus hinnapäringu tegemisest vastava hinnapakkumise esitamiseni kõigi asjaomase finantsinstrumendiga seotud noteeringute puhul.

*Artikkel 9***Aruandevahemike kindlaksmääramine**

Täitmiskohad esitavad artikli 4 kohased täidetud tehingud järgmiste vahemike kaupa:

- a) kõigi finantsinstrumentide puhul peale rahaturuinstrumentide:
 - i) 1. vahemik: suurem kui 0 eurot ja väiksem kui turu tavamaht või finantsinstrumendile omane maht või sellega võrdne;
 - ii) 2. vahemik: suurem kui turu tavamaht või finantsinstrumendile omane maht ja väiksem kui suuremahuline või sellega võrdne;
 - iii) 3. vahemik: suurem kui suuremahuline;
- b) mittelikviidsete aktsiate, börsil kaubeldavate fondide ja sertifikaatide puhul:
 - i) 1. vahemik: suurem kui 0 eurot ja väiksem kui asjaomase instrumendiliigi väikseim võimalik turu tavamaht või sellega võrdne;
 - ii) 2. vahemik: suurem kui asjaomase instrumendiliigi väikseim võimalik turu tavamaht ja väiksem kui suuremahuline või sellega võrdne;
 - iii) 3. vahemik: suurem kui suuremahuline;
- c) rahaturuinstrumentide puhul:
 - i) 1. vahemik: suurem kui 0 eurot ja väiksem kui 10 miljonit eurot või sellega võrdne;
 - ii) 2. vahemik: suurem kui 10 miljonit eurot ja väiksem kui 50 miljonit eurot või sellega võrdne;
 - iii) 3. vahemik: suurem kui 50 miljonit eurot.

*Artikkel 10***Avaldamisvorm**

Täitmiskohad avaldavad iga kauplemispäeva kohta teabe masinloetavas elektroonilises vormingus kooskõlas lisas esitatud vormidega, nii et avalikkusel on võimalik see teave alla laadida.

*Artikkel 11***Teabe avaldamise sagedus**

Täitmiskohad avaldavad teabe kvartalite kaupa ja hiljemalt kolm kuud pärast iga kvartali lõppu, see tähendab

- a) 30. juuniks teabe 1. jaanuarist 31. märtsini kestnud ajavahemiku kohta;
- b) 30. septembriks teabe 1. aprillist 30. juunini kestnud ajavahemiku kohta;
- c) 31. detsembriks teabe 1. juulist 30. septembrini kestnud ajavahemiku kohta;
- d) 31. märtsiks teabe 1. oktoobrist 31. detsembrini kestnud ajavahemiku kohta.

*Artikkel 12***Jõustumine ja kohaldamine**

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Seda kohaldatakse alates 3. jaanuarist 2018.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 8. juuni 2016

Komisjoni nimel
president
Jean-Claude JUNKER

	Suuruse- vahemik	Kõik tehingud, mis täideti esimese kahe minuti jooksul alates ajast T		Esimene tehing alates ajast T (kui puuduvad tehingud esimese kahe minuti jooksul alates ajast T)						
Aeg (T)		Lihtne keskmine täitmishind (v.a vahendustasud ja kogunenud intressid)	Täidetud tehingute kogu- väärtus	Hind	Täitmise aeg	Tehingu suurus	Kauple- missüs- teem	Kauple- misre- žiim	Kauple- misplat- vorm	Parim ostu- ja müügipakku- mine või sobiv võrdlushind täitmise ajal
13.30.00	1									
	2									
	3									
15.30.00	1									
	2									
	3									

Tabel 4. Artikli 4 punkti b kohaselt avaldatav teave hinna kohta

Lihtne keskmine tehinguhind	
Mahuga kaalutud tehinguhind	
Suurim täitmishind	
Väikseim täitmishind	

Tabel 5. Artikli 5 kohaselt avaldatav teave kulude kohta

Artikli 5 punktide a–d kohaselt nõutav teave	(Kirjeldus)
Veebisaidi või muu allika link, kust võib leida kulude kohta lisateavet	
Kõigi pakutud hinnavähenduste, allahindluste või muude maksete koguväärtus (protsent aruandeperioodi tehingute koguväärtusest)	%
Kõigi kulude koguväärtus (protsent aruandeperioodi tehingute koguväärtusest)	%

Tabel 6. Artikli 6 kohaselt avaldatav teave täitmise tõenäosuse kohta

Saadud korralduste või hinnapäringute arv	
Täidetud tehingute arv	
Täidetud tehingute koguväärtus	
Saadud, kuid tühistatud korralduste või hinnapäringute arv	

Saadud, kuid muudetud korralduste või hinnapäringute arv	
Tehingute mediaansuurus	
Kõigi korralduste või hinnapäringute mediaansuurus	
Määratud turutegijate arv	

Tabel 7. Artikli 7 lõike 1 kohaselt avaldatav teave täitmise tõenäosuse kohta

Aeg	Parim ostupakkumine	Parim müügi-pakkumine	Ostupakkumise suurus	Müügi-pakkumise suurus	Tellimusraamatu sügavus kolme hinnalisandi puhul
9.30.00					
11.30.00					
13.30.00					
15.30.00					

Tabel 8. Artikli 7 lõigete 2 ja 3 kohaselt avaldatav teave

Keskmine efektiivne hinnavahe	
Keskmine maht parima ostu- ja müügi-pakkumise puhul	
Keskmine hinnavahe parima ostu- ja müügi-pakkumise puhul	
Tühistamiste arv parima ostu- ja müügi-pakkumise puhul	
Muudatuste arv parima ostu- ja müügi-pakkumise puhul	
Tellimusraamatu keskmine sügavus kolme hinnalisandi puhul	
Keskmine aeg (millisekundi täpsusega), mis kulus aktiivse korralduse või noteeringu vastuvõtmise kättesaamisest täitmiskoha poolt sellele järgneva täieliku või osalise täitmiseni	
Mediaanaeg (millisekundi täpsusega), mis kulus turukorralduse kättesaamisest täitmiskoha poolt sellele järgneva täieliku või osalise täitmiseni	
Muutmata passiivsete korralduste täitmise keskmine kiirus parima ostu- ja müügi-pakkumise puhul	
Luhtunud täida-või-tühista-korralduste arv	
Täiesti täitmata täida-kohe-või-tühista-korralduste arv	
Kauplemiskohas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 või 9 kohaselt täidetud suuremahuliste tehingute arv	
Kauplemiskohas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 või 9 kohaselt täidetud suuremahuliste tehingute väärtus	

Kauplemiskohas MiFIRi artikli 4 või 9 kohaselt täidetud tehingute arv, v.a kauplemiskoha korralduste haldamise süsteemis hoitavad ja avaldamist ootavad ning mittesuuremahulised korraldused	
Kauplemiskohas MiFIRi artikli 4 või 9 kohaselt täidetud tehingute väärtus, v.a kauplemiskoha korralduste haldamise süsteemis hoitavad ja avaldamist ootavad ning mittesuuremahulised korraldused	
Kauplemiskatkestuste arv	
Kauplemiskatkestuste keskmine kestus	
Peatamiste arv	
Peatamiste laad	
Peatamiste keskmine kestus	
Kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi kasutavate kohtade puhul selliste perioodide arv, mil noteeringuid ei antud	
Kestval noteeringute andmisel põhinevat kauplemissüsteemi kasutavate kohtade puhul selliste perioodide keskmine kestus, mil noteeringuid ei antud	
Noteeringute keskmine osakaal	

Tabel 9. Artikli 8 kohaselt avaldatav teave

Keskmine aeg, mis kulus vastuvõtmisest täitmiseni	
Mediaanaeg, mis kulus vastuvõtmisest täitmiseni	
Keskmine aeg, mis kulus hinnapäringu tegemisest hinnapakkumise esitamiseni	
Mediaanaeg, mis kulus hinnapäringu tegemisest hinnapakkumise esitamiseni	