

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/575**(2016. gada 8. jūnijs),****ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem saistībā ar darījumu izpildes kvalitātes datiem, kas jāpublicē izpildes vietām****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Direktīvu 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/EK un Direktīvu 2011/61/ES ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 27. panta 10. punkta pirmās daļas a) apakšpunktu,

tā kā:

- (1) Lai publiskajām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām sniegtu būtiskus datus par izpildes kvalitāti un tādējādi palīdzētu tām noteikt, kā vislabāk izpildīt klientu rīkojumus, ir svarīgi noteikt konkrēto saturu, formātu un periodiskumu tirdzniecības vietu un sistemātisko internalizētāju publicējamajiem datiem par tādu finanšu instrumentu, uz kuriem attiecas Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 600/2014 ⁽²⁾ 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, izpildes kvalitāti. Ir svarīgi noteikt arī konkrēto saturu, formātu un periodiskumu datiem, kuri izpildes vietām ir jāpublicē par tādu citu finanšu instrumentu, uz kuriem neattiecas pienākums veikt tirdzniecību, izpildes kvalitāti. Šajā sakarā būtu pienācīgi jāņem vērā izpildes vietas veids un attiecīgā finanšu instrumenta veids.
- (2) Lai pilnībā novērtētu Savienībā notiekošo darījumu izpildes kvalitāti, ir lietderīgi, ka izpildes vietas, kuras ieguldījumu brokeru sabiedrības var izvēlēties, lai izpildītu klientu rīkojumus, atbilst prasībām par datiem, kas izpildes vietām jāsniedz saskaņā ar šo regulu. Šajā nolūkā minētajām izpildes vietām būtu jāietver arī regulēti tirgi, daudzpusējas tirdzniecības sistēmas, organizētas tirdzniecības sistēmas, sistemātiski internalizētāji, tirgus uzturētāji un citi likviditātes nodrošinātāji.
- (3) Ņemot vērā atšķirīgos izpildes vietu un finanšu instrumentu veidus, ziņojumu saturam vajadzētu atšķirties atkarībā no vairākiem faktoriem. Ir lietderīgi diferencēt paziņoto datu apjomu un raksturu atbilstoši tirdzniecības sistēmām, tirdzniecības veidiem un tirdzniecības platformām, lai nodrošinātu pareizu kontekstu iegūtajiem izpildes kvalitātes datiem.
- (4) Lai izvairītos no nepiemērota salīdzinājuma starp izpildes vietām un nodrošinātu apkopoto datu būtiskumu, izpildes vietām vajadzētu iesniegt atsevišķus ziņojumus, kas atbilst segmentiem, kuri uztur atšķirīgus rīkojumu reģistrus vai kuri tiek atšķirīgi regulēti vai izmanto atšķirīgus tirgus segmentu identifikatorus.
- (5) Lai nodrošinātu precīzu priekšstatu par faktiski veiktās izpildes kvalitāti, tirdzniecības vietām nevajadzētu starp datiem par izpildītajiem rīkojumiem publicēt datus par tādiem rīkojumiem, ko tirgo ārpusbiržas tirgos un par kuriem ziņo tirdzniecības vietā.
- (6) Ja tirgus uzturētāji un citi likviditātes nodrošinātāji kā izpildes vietas sniedz ziņojumus par tādiem finanšu instrumentiem, uz kuriem neattiecas pienākums veikt tirdzniecību, tiem būtu jāpublicē tikai informācija par izpildītajiem rīkojumiem vai saviem klientiem piedāvāto cenu, ja rīkojumi ir vai nu kotēti vai izpildīti kā ārpusbiržas darījumi, vai izpildīti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. un 9. pantu, izņemot rīkojumus, kurus uzglabā tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā, gaidot brīdi, kad informācija jāpublisko.
- (7) Ir lietderīgi ņemt vērā, ka pie citiem likviditātes nodrošinātājiem būtu jāpieder sabiedrībām, kuras izrāda vēlmi veikt darījumus savā vārdā un kurām likviditātes nodrošināšana ir daļa no to parastās saimnieciskās darbības, neatkarīgi no tā, vai tām ir oficiāli nolīgumi un vai tās aņņemas pastāvīgi nodrošināt likviditāti.

⁽¹⁾ OVL 173, 12.6.2014., 349. lpp.⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Regula (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OVL 173, 12.6.2014., 84. lpp.).

- (8) Lai nodrošinātu pilnīgu pārredzamību par darījumu izpildes kvalitāti attiecībā uz cenu, būtu lietderīgi no sniegtās informācijas par cenu attiecīgā gadījumā izslēgt visas komisijas vai uzkrātos procentus, ja piemērojams.
- (9) Nosakot atbilstīgu informāciju cenas kvalitātes izvērtēšanai, būtu vajadzīga informācija gan par diennakts vidējiem līmeņiem, gan attiecīgā laika brīža informācija. Tas nodrošinās dalībniekiem atbilstīgu kontekstu un pilnīgāku ainu sasniegtās izpildes kvalitātes analizē. Lai būtu iespējams veikt cenas salīdzinājumu starp finanšu instrumentiem, ir nepieciešams arī precizēt katra paziņotā darījuma valūtas kodu.
- (10) Lai nodrošinātu regulējuma saskaņotību, nav lietderīgi prasīt, lai tirdzniecības vietas sniegtu informāciju par darījumiem, uz kuriem publicēšanas laikā joprojām attiecas publicēšanas atlikšana saskaņā ar pēctirdzniecības pārredzamības prasībām. Ir lietderīgi, ka sistemātiskie internalizētāji, tirgus uzturētāji un citi likviditātes nodrošinātāji ir atbrīvoti no pienākuma ziņot attiecīgā laika brīža darījuma datus par jebkādiem darījumiem, kas pārsniedz standarta tirgus apjomu vai finanšu instrumentam raksturīgo apjomu, lai izvairītos no tā, ka šīs vietas tiek pakļautas nepamatotam riskam atklāt sensitīvu komercinformāciju, kas varētu kavēt to spējas ierobežot riska darījumu risku un nodrošināt likviditāti. Akcijām, biržā tirgotiem fondiem un sertifikātiem, ko saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 600/2014 uzskata par nelikvīdiem, izmantojamā standarta tirgus apjoma robežvērtība ir minimālais pieejamais standarta tirgus apjoms šāda veida finanšu instrumentiem. Lai izvairītos no nenoteiktības, ir lietderīgi precizēt, ka atsaucei uz lielu apjomu un finanšu instrumentam raksturīgo apjomu ir tāda pati nozīme, kā izklāstīts pēctirdzniecības pārredzamības prasībās.
- (11) Ja ar konkrētas vietas starpniecību tiek izpildīts rīkojums, ir svarīgi nodrošināt pilnīgu pārredzamību attiecībā uz visām izmaksām. Ir jānorāda visas izmaksas, kuras, izpildot klienta rīkojumu, rodas saistībā ar konkrētās vietas izmantošanu un kuras tieši vai netieši sedz klients. Šīm izmaksām būtu jāietver izpildes maksas, tostarp maksas par rīkojumu iesniegšanu, labošanu vai atcelšanu vai cenu piedāvājumu atsaukšanu, kā arī jebkādas maksas, kas saistītas ar piekļuvi tirgus datiem vai termināļu izmantošanu. Attiecīgās izmaksas var ietvert arī tūrvērtes vai norēķinu maksas vai jebkādas citas maksas, kas jāmaksā rīkojuma izpildē iesaistītām trešām personām, ja tās ir daļa no izpildes vietas sniegtajiem pakalpojumiem. Informācijai par izmaksām būtu jāietver arī nodokļi vai nodevas, par kurām vietai tieši piestādīts rēķins vai kuras tai radušās izpildes vietas locekļu vai lietotāju vārdā, vai klienta, uz kuru attiecas rīkojums, vārdā.
- (12) Izpildes iespējamība norāda, kāda ir konkrētā veida rīkojuma izpildes varbūtība, un to pamato informācija par konkrēta instrumenta tirdzniecības apjomiem vai citiem rīkojumu un darījumu raksturlielumiem. Informācijai par izpildes iespējamību vajadzētu sniegt iespēju aprēķināt tādas rādītājus kā vietas relatīvais tirgus apjoms attiecībā uz konkrētu finanšu instrumentu vai finanšu instrumentu kategoriju. Izpildes iespējamība būtu jāizvērtē arī, izmantojot datus par darījumiem, kas nav izdevušies vai tikuši atcelti, vai par labotiem rīkojumiem.
- (13) Izpildes ātrumam attiecībā uz dažādu veidu izpildes vietām var būt dažādas nozīmes, jo ātruma mērīšana atšķiras gan atkarībā no tirdzniecības sistēmām, gan no tirdzniecības platformas. Pastāvīgas izsoles rīkojumu reģistriem izpildes ātrums būtu jāizsaka milisekundēs, savukārt attiecībā uz citām tirdzniecības sistēmām ir lietderīgi izmantot lielākas laika vienības. Tāpat ir lietderīgi neiekļaut neiekļaut informāciju par to, cik latents ir konkrēta dalībnieka savienojums ar izpildes vietu, jo pati izpildes vieta to nespēj kontrolēt.
- (14) Lai salīdzinātu dažādu apjomu rīkojumu izpildes kvalitāti, uz izpildes vietām būtu jāattiecas prasībai ziņot par darījumiem vairāku apjomu diapazonu dalījumā. Šo diapazonu robežvērtībām vajadzētu būt atkarīgām no finanšu instrumenta veida un tā likviditātes, lai nodrošinātu, ka tās sniedz adekvātu izpildes paraugu tādā apjomā, kas raksturīgs attiecīgajam instrumentam.
- (15) Ir svarīgi, lai izpildes vietas apkopotu datus visā to parastajā darbības laikā. Tāpēc ziņošana būtu jāveic bez maksas mašīnlasāmā elektroniskā formātā, izmantojot tīmekļa vietni, lai dotu iespēju sabiedrībai lejupielādēt, meklēt, šķirot un analizēt visus sniegtos datus.
- (16) Izpildes vietu ziņojumi būtu jāpapildina ar konsolidētu datu lentes, kas izveidota saskaņā ar Direktīvu 2014/65/ES, nodrošinātāja sniegtajiem datiem, tādējādi dodot iespēju izstrādāt pastiprinātus izpildes kvalitātes pasākumus.

- (17) Konsekvences labad un lai nodrošinātu finanšu tirgu netraucētu darbību, ir nepieciešams, ka šajā regulā izklāstītos noteikumus piemēro no tās pašas dienas, kurā sāk piemērot Direktīvā 2014/65/ES un Regulā (ES) Nr. 600/2014 izklāstītos noteikumus.
- (18) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai ir iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).
- (19) EVTI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanos par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ 37. pantu izveidotās Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Priekšmets

Šajā regulā ir noteikts uz izpildes kvalitāti attiecošos datu, kas jāpublicē izpildes vietām, konkrētais saturs, formāts un periodiskums. To piemēro attiecībā uz tirdzniecības vietām, sistematiskiem internalizētājiem, tirgus uzturētājiem vai citiem likviditātes nodrošinātājiem.

2. pants

Definīcijas

Šajā regulā piemēro šādas definīcijas:

- a) "tirdzniecības sistēma" ir veids, kādā izpildes vieta izpilda rīkojumus, piemēram, kā pastāvīgas izsoles rīkojumu reģistrs, cenu piedāvājuma virzīta nepārtrauktas tirdzniecības sistēma, cenu piedāvājumu pieprasīšanas sistēma, periodiskas izsoles vai jebkāda hibrīdsistēma, kas iedalāma divās vai vairākās no šīm kategorijām vai sistēmā, kurā cenu noteikšanas process atšķiras no tā, kas piemērojams iepriekš izklāstīto veidu sistēmās;
- b) "finanšu instrumentam raksturīgais apjoms" ir apjoms, kas raksturīgs tirdzniecības vietā tirgotai obligācijai, strukturētam finanšu produktam, emisijas kvotai vai atvasinātam instrumentam, kam nav likvida tirgus un ar kuriem veikto darījumu publicēšana ir atlikta saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. pantu;
- c) "liels apjoms" nozīmē liela apjoma rīkojumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 7. un 11. pantu;
- d) "neizdevies darījums" ir darījums, kuru izpildes vieta ir anulējusi;
- e) "cenas reizinātājs" ir pamatā esošā instrumenta vienību skaits, ko pārstāv viens atvasinātā instrumenta līgums;
- f) "cenas pieraksts" ir norāde par to, vai darījuma cena ir izteikta monetārā vērtībā, procentos vai peļņā;
- g) "daudzuma pieraksts" ir norāde par to, vai darījuma daudzums ir izteikts vienību skaitā vai nominālā vērtībā, vai monetārā vērtībā;
- h) "piegādes veids" ir norāde par to, vai norēķins par finanšu instrumentu notiek fiziskos aktīvos vai naudā, tostarp gadījumos, kad darījuma partneris var izvēlēties vai kad to nosaka trešā puse;
- i) "tirdzniecības režīms" ir plānota sākumizsole, noslēgumizsole vai tekošās dienas izsole, neplānota izsole, tirgus slēgšanas tirdzniecība, tirdzniecība ārpus galvenās sesijas vai ziņojumu par tirdzniecību sniegšana;
- j) "tirdzniecības platforma" ir izpildes vietas uzturētās platformas veids: elektroniskā, balss vai fiziskas sasaukšanās platforma;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

- k) "rīkojumu reģistra dziļums" ir kopējā pieejamā likviditāte, kas izteikta kā cenas un apjoma rezultāts visiem pirkšanas un pārdošanas piedāvājumiem attiecībā uz konkrētu cenas pieaugumu skaitu no labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma vidējās cenas;
- l) "vidējā efektīvā starpība" ir vidējā divkāršā starpība starp faktisko izpildes cenu salīdzinājumā ar labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma vidējo cenu saņemšanas brīdī rīkojumiem vai tirgojamiem ierobežojošiem rīkojumiem;
- m) "vidējais izpildes ātrums pasīviem rīkojumiem, kuri nav laboti, pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma" ir vidējais laiks, kas pagājis starp ierobežošu rīkojumu, kurš atbilst izpildes vietas saņemtajam labākajam pirkšanas un pārdošanas piedāvājumam, un sekojošu šā rīkojuma izpildi;
- n) "agresīvs rīkojums" ir rīkojums, kurš reģistrēts rīkojumu reģistrā un kas mazinājis likviditāti;
- o) "pasīvs rīkojums" ir rīkojums, kurš reģistrēts rīkojumu reģistrā, kas nodrošinājis likviditāti;
- p) "tūlītēji izpildāms vai atceļams (*immediate or cancel*) rīkojums" ir rīkojums, ko izpilda līdz ar tā iereģistrēšanu rīkojumu reģistrā un kas nepaliek rīkojumu reģistrā attiecībā ne uz kādu atlikušo neizpildīto daudzumu;
- q) "tūlītēji pilnībā izpildāms vai atceļams (*fill or kill*) rīkojums" ir rīkojums, ko izpilda līdz ar tā iereģistrēšanu rīkojumu reģistrā, ar nosacījumu, ka to ir iespējams izpildīt pilnībā. Ja rīkojumu var izpildīt tikai daļēji, to automātiski noraida un neizpilda.

3. pants

Informācijas par izpildes vietu un finanšu instrumentu publicēšana

1. Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, publicē informāciju par izpildes vietas veidu saskaņā ar šā punkta trešo daļu.

Izpildes vietas attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tās darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, publicē informāciju par izpildes vietas veidu saskaņā ar šā punkta trešo daļu.

Pielikuma 1. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- i) izpildes vietas nosaukums un vietas identifikators;
- ii) kompetentās iestādes atrašanās vietas valsts;
- iii) tirgus segmenta nosaukums un tirgus segmenta identifikators;
- iv) tirdzniecības dienas datums;
- v) visu tādu vietas parastajā tirdzniecības periodā notikušu pārtraukumu veids, skaits un vidējais ilgums, kuri pārtraukuši tirdzniecību ar visiem attiecīgajai vietai tirdzniecības dienas datumā tirdzniecībā pieejamajiem instrumentiem;
- vi) visu vietas parastajā tirdzniecības periodā tirdzniecības dienas datumā plānoto izsoļu veids, skaits un vidējais ilgums;
- vii) neizdevušos darījumu skaits tirdzniecības dienas datumā;
- viii) neizdevušos darījumu vērtība, izteikta procentos no to darījumu kopējās vērtības, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības dienas datumā.

2. Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, publicē informāciju par finanšu instrumenta veidu saskaņā ar šā punkta trešo daļu.

Izpildes vietas attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tās darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, publicē informāciju par finanšu instrumenta veidu saskaņā ar šā punkta trešo daļu.

Pielikuma 2. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem ir identifikatori, kā izklāstīts pielikuma 2. tabulā:
 - i) nosaukums un finanšu instrumenta identifikators;
 - ii) instrumenta klasifikācija;
 - iii) valūta;
- b) attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem nav identifikatoru, kā izklāstīts pielikuma 2. tabulā:
 - i) nosaukums un rakstisks instrumenta apraksts, tostarp pamatā esošā instrumenta valūta, cenas reizinātājs, cenas pieraksts, daudzuma pieraksts un piegādes veids;
 - ii) instrumenta klasifikācija;
 - iii) valūta.

4. pants

Cena

Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo un ceturto daļu publicē informāciju par cenu katrai tirdzniecības dienai, kurā tikuši izpildīti rīkojumi attiecībā uz finanšu instrumentu.

Tirdzniecības vietas attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo un ceturto daļu publicē informāciju par cenu katrai tirdzniecības dienai, kurā tikuši izpildīti rīkojumi attiecībā uz finanšu instrumentu.

Publicē šādu informāciju:

- a) tekošās dienas informācija:
 - i) tirdzniecības vietām – vienkārša vidējā cena visiem darījumiem, kas tikuši izpildīti divu minūšu laikā, sākot no katra no šiem atsaucēs laikiem: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 un 15.30.00 pēc koordinētā universālā laika attiecīgajā datumā, un katram apjoma diapazonam, kā izklāstīts 9. pantā;
 - ii) sistemātiskiem internalizētājiem, tirgus uzturētājiem un citiem likviditātes nodrošinātājiem – vienkārša vidējā cena visiem darījumiem, kas tikuši izpildīti divu minūšu laikā, sākot no katra no šiem atsaucēs laikiem: 9.30.00, 11.30.00, 13.30.00 un 15.30.00 pēc koordinētā universālā laika attiecīgajā datumā, 1. apjoma diapazonā, kā izklāstīts 9. pantā;
 - iii) divu minūšu periodā, kas minēts i) un ii) apakšpunktā, izpildīto tirdzniecības darījumu kopējā vērtība;
 - iv) tirdzniecības vietām – ja attiecīgo i) apakšpunktā minēto laika periodu pirmo divu minūšu laikā darījumi nav notikuši, – cena katrā apjoma diapazonā, kā noteikts 9. pantā, pirmajam pēc katra no i) apakšpunktā noteiktajiem atsaucēs termiņiem attiecīgajā datumā izpildītajam darījumam, ja tāds ir;
 - v) sistemātiskiem internalizētājiem, tirgus uzturētājiem un citām likviditātes nodrošinātājiem – ja attiecīgo ii) apakšpunktā minēto laika periodu pirmo divu minūšu laikā darījumi nav notikuši, – cena pirmajam 1. apjoma diapazonā, kā noteikts 9. pantā, pēc katra no ii) apakšpunktā noteiktajiem atsaucēs termiņiem attiecīgajā datumā izpildītajam darījumam, ja tāds ir;
 - vi) izpildes laiks par katru darījumu, kas minēts iv) un v) apakšpunktā;
 - vii) darījuma apjoms vērtības izteiksmē par katru izpildīto darījumu, kas minēts iv) un v) apakšpunktā;
 - viii) tirdzniecības sistēma un tirdzniecības režīms, saskaņā ar kuru tikuši izpildīti iv) un v) apakšpunktā minētie darījumi;
 - ix) tirdzniecības platforma, kurā tikuši izpildīti iv) un v) apakšpunktā minētie darījumi;
 - x) labākais pirkšanas un pārdošanas piedāvājums vai piemērotās atsaucēs cenas katra iv) un v) apakšpunktā minētā izpildītā darījuma izpildes laikā.

Tekošās dienas informāciju publicē tādā formātā, kā izklāstīts pielikuma 3. tabulā;

- b) dienas informācija:
- i) vienkārša vidējā un pēc apjoma svērtā vidējā darījumu cena, ja noticis vairāk nekā viens darījums;
 - ii) augstākā izpildes cena, ja notikuši vairāk nekā divi darījumi;
 - iii) zemākā izpildes cena, ja notikuši vairāk nekā divi darījumi.

Dienas informāciju publicē tādā formātā, kā izklāstīts pielikuma 4. tabulā.

5. pants

Izmaksas

Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē informāciju par izmaksām, ko tirdzniecības vieta piemēro jebkuram tirdzniecības vietas loceklim vai lietotājam.

Izpildes vietas attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē informāciju par izmaksām, ko izpildes vieta piemēro jebkuram izpildes vietas loceklim vai lietotājam.

Pielikuma 5. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) apraksts par visu izmaksu komponentu, ko piemēro izpildes vieta, veidu un līmeni pirms jebkādu procentu likmes subsīdiju vai atlaižu piemērošanas, un informācija par to, kā šīs izmaksas atšķiras atkarībā no iesaistītā finanšu instrumenta lietotāja, un attiecīgās atšķirību summas. Izmaksu komponenti ietver:
 - i) izpildes maksas;
 - ii) maksas par rīkojumu vai cenu piedāvājumu iesniegšanu, labošanu vai atcelšanu;
 - iii) maksas saistībā ar piekļuvi tirgus datiem un termināļu izmantošanu;
 - iv) visas tīrvērtes un norēķinu maksas un visas citas maksas trešām personām, kuras iesaistītas rīkojuma izpildē;
- b) apraksts par visu izpildes vietas lietotājiem piedāvāto procentu likmes subsīdiju, atlaižu vai citu maksājumu veidu un apjomu, tostarp informācija par to, kā šīs procentu likmes subsīdijas, atlaides vai citi maksājumi atšķiras atkarībā no iesaistītā finanšu instrumenta lietotāja, un to atšķirību summas;
- c) apraksts par visu izpildes vietas lietotājiem piedāvāto nemonetāro labumu veidu un summu, tostarp informācija par to, kā šie nemonetārie labumi atšķiras atkarībā no iesaistītā finanšu instrumenta lietotāja, un to atšķirību vērtība;
- d) apraksts par visu nodokļu vai nodevu veidu un lielumu, par kuriem vietai tieši piestādīts rēķins vai kas tai radušies izpildes vietas locekļu vai lietotāju vārdā, vai klienta, uz kuru attiecas rīkojums, vārdā;
- e) saite uz vietas tīmekļa vietni vai jebkuru citu avotu, kur ir pieejama papildu informācija par izmaksām;
- f) visu procentu likmes subsīdiju, atlaižu, nemonetāro labumu vai citu maksājumu, kā izklāstīts b) un c) punktā, kopējā vērtība, izteikta kā procentuālā daļa no kopējās tirdzniecības vērtības pārskata periodā;
- g) visu izmaksu, kā izklāstīts a) punktā, neskaitot procentu likmes subsīdijas, atlaides, nemonetāros labumus vai citus maksājumus, kā izklāstīts b) un c) punktā, kopējā vērtība, izteikta kā procentuālā daļa no kopējās tirdzniecības vērtības pārskata periodā.

6. pants

Izpildes iespējamība

Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē informāciju par izpildes iespējamību katrai tirdzniecības dienai.

Izpildes vietas attiecībā uz katru tirgus segmentu, kurā tie darbojas, un katru tādu finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā paredzētais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē informāciju par izpildes iespējamību katrai tirdzniecības dienai.

Pielikuma 6. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) rīkojumu vai cenu piedāvājuma pieprasījumu skaits, ja tādi ir saņemti;
- b) izpildīto darījumu, ja tādu ir vairāk nekā viens, skaits un vērtība;
- c) tādu saņemto rīkojumu vai cenu piedāvājuma pieprasījumu skaits, kuri tikuši atcelti vai atsaukti, izņemot pasīvos rīkojumus ar norādījumiem, kuriem beigsies termiņš vai kuri jāatceļ dienas beigās;
- d) tādu saņemto rīkojumu vai cenu piedāvājuma pieprasījumu skaits, kuri attiecīgajā datumā tikuši laboti;
- e) mediānais darījumu apjoms attiecīgajā datumā, ja noticis vairāk nekā viens darījums;
- f) mediānais visu rīkojumu vai cenu piedāvājuma pieprasījumu apjoms attiecīgajā datumā, ja ticis saņemts vairāk nekā viens rīkojums vai cenu piedāvājuma pieprasījums;
- g) izraudzīto tirgus uzturētāju skaits.

7. pants

Papildu informācija pastāvīgas izsoles rīkojumu reģistram un cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas izpildes vietām

1. Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji, kas darbojas pastāvīga izsoles rīkojumu reģistra, cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas vai cita veida tirdzniecības sistēmas ietvaros, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, 4. panta a) punkta i) un ii) apakšpunktā noteiktajos atsaucē laikos saskaņā ar šā punkta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Izpildes vietas, kas darbojas pastāvīga izsoles rīkojumu reģistra, cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas vai cita veida tirdzniecības sistēmas ietvaros, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, 4. panta a) punkta i) un ii) apakšpunktā noteiktajos atsaucē laikos saskaņā ar šā punkta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Pielikuma 7. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- i) labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma cena un attiecīgie apjomi;
- ii) rīkojumu reģistra dziļums trim cenas pieaugumiem.

2. Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji, kas darbojas pastāvīga izsoles rīkojumu reģistra, cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas vai cita veida tirdzniecības sistēmas ietvaros, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā punkta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Izpildes vietas, kas darbojas pastāvīga izsoles rīkojumu reģistra, cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas vai cita veida tirdzniecības sistēmas ietvaros, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā punkta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Pielikuma 8. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) vidējā efektīvā starpība;
- b) vidējais apjoms pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma;
- c) vidējā starpība pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma;
- d) atcelšanu skaits pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma;
- e) labojumu skaits pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma;
- f) vidējais rīkojumu reģistra dziļums 3 cenas pieaugumiem;

- g) vidējais aritmētiskais un mediānais laiks, kas pagājis starp izpildes vietas saņemta agresīva rīkojuma vai cenas piedāvājuma pieņemšanu un sekojošu pilnīgu vai daļēju izpildi;
- h) vidējais izpildes ātrums pasīviem rīkojumiem, kuri nav laboti, pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma;
- i) tādu tūlītēji pilnībā izpildāmu vai atceļamu (*fill or kill*) rīkojumu skaits, kuru izpilde nav izdevusies;
- j) tādu tūlītēji izpildāmu vai atceļamu (*immediate or cancel*) rīkojumu skaits, kuru izpildes likme ir nulle;
- k) tādu darījumu skaits un vērtība, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā un kuri ir liela apjoma saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu;
- l) tādu darījumu skaits un vērtība, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu, izņemot rīkojumus, kurus uzglabā tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā, gaidot brīdi, kad informācija jāpublisko, un kuri nav iekļauti k) apakšpunktā;
- m) tādu tirdzniecības pārtraukumu skaits un vidējais ilgums, kuri radušies jebkādu svārstīguma izsoļu vai bloķēšanas sistēmu darbības rezultātā vietas parastā tirdzniecības perioda laikā;
- n) tādu tirdzniecības apturēšanu veids, skaits un vidējais ilgums, kuras radušās vietas lēmuma rezultātā vietas parastā tirdzniecības perioda laikā, izņemot 3. panta 1. punkta v) apakšpunktā norādīto pārtraukumu laikā.

3. Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji, kas pilnībā vai daļēji darbojas cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas ietvaros, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā punkta trešo daļu publicē papildu informāciju.

Izpildes vietas, kas pilnībā vai daļēji darbojas cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas tirdzniecības sistēmas ietvaros, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, publicē papildu informāciju saskaņā ar šā punkta trešo daļu.

Pielikuma 8. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) katrai tirdzniecības dienai – visu tādu vietas parastā tirdzniecības laika periodu skaits un vidējais ilgums, kuri ilguši vairāk nekā 15 minūtes un kuru laikā nav ticis sniegts neviens piedāvājums vai piedāvājums;
- b) vidējais cenas piedāvājuma esības rādītājs, kas izteikts procentos no vietas parastā tirdzniecības perioda attiecīgajā datumā.

8. pants

Papildu informācija cenas piedāvājuma pieprasījumu izpildes vietām

Tirdzniecības vietas un sistemātiskie internalizētāji, kas darbojas saskaņā ar cenu piedāvājumu pieprasīšanas tirdzniecības sistēmu vai jebkāda cita veida tirdzniecības sistēmu, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tie uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Izpildes vietas, kas darbojas saskaņā ar cenu piedāvājumu pieprasīšanas tirdzniecības sistēmu vai jebkāda cita veida tirdzniecības sistēmu, kurai šī informācija ir pieejama, par katru tirgus segmentu, kuru tās uztur, un par katru finanšu instrumentu, uz kuru neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 23. un 28. pantā noteiktais pienākums veikt tirdzniecību, saskaņā ar šā panta trešo daļu publicē papildu informāciju par katru tirdzniecības dienu.

Pielikuma 9. tabulā noteiktajā formātā publicē šādu informāciju:

- a) vidējais aritmētiskais laiks un mediānais laiks, kas pagājis starp cenas piedāvājuma pieņemšanu un izpildi, – visiem darījumiem ar attiecīgo finanšu instrumentu; un
- b) vidējais aritmētiskais laiks un mediānais laiks, kas pagājis starp cenas piedāvājuma pieprasījumu un jebkādu atbilstīgu cenas piedāvājumu sniegšanu, – visiem cenas piedāvājumiem attiecībā uz attiecīgo finanšu instrumentu.

*9. pants***Ziņošanas diapazonu noteikšana**

Izpildes vietas ziņo par izpildītajiem darījumiem, kā norādīts 4. pantā, šādos diapazonos:

- a) visiem finanšu instrumentiem, kas nav naudas tirgus instrumenti:
 - i) 1. diapazons: lielāks par EUR 0 un mazāks vai vienāds ar standarta tirgus apjomu vai finanšu instrumentam raksturīgo apjomu;
 - ii) 2. diapazons: lielāks par standarta tirgus apjomu vai finanšu instrumentam raksturīgo apjomu un mazāks vai vienāds ar lielu apjomu;
 - iii) 3. diapazons: lielāks par lielu apjomu;
- b) nelikvidām akcijām, biržā tirgotiem fondiem vai sertifikātiem:
 - i) 1. diapazons: lielāks par EUR 0 un mazāks vai vienāds ar mazāko pieejamo standarta tirgus apjomu attiecīgajam instrumentu veidam;
 - ii) 2. diapazons: lielāks par mazāko pieejamo standarta tirgus apjomu attiecīgajam instrumentu veidam un mazāks vai vienāds ar lielu apjomu;
 - iii) 3. diapazons: lielāks par lielu apjomu;
- c) naudas tirgus instrumentiem:
 - i) 1. diapazons: lielāks par EUR 0 un mazāks vai vienāds ar EUR 10 miljoniem;
 - ii) 2. diapazons: lielāks par EUR 10 miljoniem un mazāks vai vienāds ar EUR 50 miljoniem;
 - iii) 3. diapazons: lielāks par EUR 50 miljoniem.

*10. pants***Publicēšanas formāts**

Izpildes vietas par katru tirdzniecības dienu mašīnlasāmā elektroniskā formātā atbilstīgi pielikumā sniegtajām veidnēm publicē informāciju, kura ir publiski pieejama lejupielādei.

*11. pants***Publicējamās informācijas regularitāte**

Izpildes vietas informāciju publicē reizi ceturksnī un ne vēlāk kā trīs mēnešus pēc katra ceturkšņa beigām, šādi:

- a) līdz 30. jūnijam – informāciju par laikposmu no 1. janvāra līdz 31. martam;
- b) līdz 30. septembrim – informāciju par laikposmu no 1. aprīļa līdz 30. jūnijam;
- c) līdz 31. decembrim – informāciju par laikposmu no 1. jūlija līdz 30. septembrim;
- d) līdz 31. martam – informāciju par laikposmu no 1. oktobra līdz 31. decembrim.

*12. pants***Stāšanās spēkā un piemērošana**

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

To piemēro no 2018. gada 3. janvāra.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2016. gada 8. jūnijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNCKER

Laiks (T)	Apjoma diapazons	Visi darījumi, kas izpildīti pirmo divu minūšu laikā pēc laika T		Pirmais darījums pēc laika T (ja nav darījumu pirmo divu minūšu laikā pēc laika T)						
		Vienkārša vidējā izpildes cena (bez komisijas maksām un uzkrātajiem procentiem)	Kopējā izpildes vērtība	Cena	Izpildes laiks	Darījuma apjoms	Tirdzniecības sistēma	Tirdzniecības režīms	Tirdzniecības platforma	Labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma cena vai piemērota atsauces cena izpildes laikā
13.30.00	1									
	2									
	3									
15.30.00	1									
	2									
	3									

4. tabula. Publicējamā cenas informācija, kā minēts 4. panta b) punktā

Vienkārša vidējā darījuma cena	
Pēc apjoma svērtā darījuma cena	
Augstākā izpildes cena	
Zemākā izpildes cena	

5. tabula. Publicējamā izmaksu informācija, kā minēts 5. pantā

Saskaņā ar 5. panta a) līdz d) punktu sniedzamā informācija	(Apraksts)
Saite uz tīmekļa vietni vai citu avotu, kur ir pieejama papildu informācija par izmaksām	
Visu piedāvāto procentu likmes subsīdiju, atlaižu vai citu maksājumu kopējā vērtība (% no kopējās tirdzniecības vērtības pārskata periodā)	%
Visu izmaksu kopējā vērtība (% no kopējās tirdzniecības vērtības pārskata periodā)	%

6. tabula. Publicējamā izpildes iespējamības informācija, kā minēts 6. pantā

Saņemto rīkojumu vai cenas piedāvājuma pieprasījumu skaits	
Izpildīto darījumu skaits	
Kopējā izpildīto darījumu vērtība	
Tādu saņemto rīkojumu vai cenas piedāvājuma pieprasījumu skaits, kuri tikuši atcelti vai atsaukti	

Tādu saņemto rīkojumu vai cenas piedāvājuma pieprasījumu skaits, kuri tikuši laboti	
Mediānais darījumu apjoms	
Visu rīkojumu vai cenas piedāvājuma pieprasījumu mediānais apjoms	
Izraudzīto tirgus uzturētāju skaits	

7. tabula. Publicējamā izpildes iespējamības informācija, kā minēts 7. panta 1. punktā

Laiks	Labākā pirkšanas piedāvājuma cena	Labākā pārdošanas piedāvājuma cena	Pirkšanas piedāvājuma apjoms	Pārdošanas piedāvājuma apjoms	Likviditātes apjoms trim cenas pieaugumiem
9.30.00					
11.30.00					
13.30.00					
15.30.00					

8. tabula. Publicējamā informācija, kā minēts 7. panta 2. un 3. punktā

Vidējā efektīvā starpība	
Vidējais apjoms pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma	
Vidējā starpība pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma	
Atceļšanu skaits pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma	
Labojumu skaits pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma	
Vidējais likviditātes apjoms 3 cenas pieaugumiem	
Vidējais aritmētiskais laiks, kas pagājis (ar precizitāti līdz milisekundēm) starp izpildes vietas saņemta agresīva rīkojuma vai cenas piedāvājuma pieņemšanu un sekojošu pilnīgu vai daļēju izpildi	
Mediānais laiks, kas pagājis (ar precizitāti līdz milisekundēm) starp tirgus rīkojuma saņemšanu izpildes vietā un sekojošu pilnīgu vai daļēju izpildi	
Vidējais izpildes ātrums pasīviem rīkojumiem, kuri nav laboti, pie labākā pirkšanas un pārdošanas piedāvājuma	
Tādu tūlītēji pilnībā izpildāmu vai atceļamu (<i>fill or kill</i>) rīkojumu skaits, kuru izpilde nav izdevusies	
Tādu tūlītēji izpildāmu vai atceļamu rīkojumu skaits, kuru izpildes likme ir nulle	
Tādu darījumu skaits, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā un kuri ir liela apjoma saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu	
Tādu darījumu vērtība, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā un kuri ir liela apjoma saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu	

Tādu darījumu skaits, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu, izņemot rīkojumus, kurus uzglabā tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā, gaidot brīdi, kad informācija jāpublisko, un kuri nav liela apjoma	
Tādu darījumu vērtība, kuri tikuši izpildīti tirdzniecības vietā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. vai 9. pantu, izņemot rīkojumus, kurus uzglabā tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā, gaidot brīdi, kad informācija jāpublisko, un kuri nav liela apjoma	
Tirdzniecības pārtraukumu skaits	
Tirdzniecības pārtraukumu vidējais ilgums	
Tirdzniecības apturēšanu skaits	
Tirdzniecības apturēšanu raksturs	
Tirdzniecības apturēšanu vidējais ilgums	
Cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas izpildes vietām – tādu periodu skaits, kuros netika sniegti cenu piedāvājumi	
Cenu piedāvājuma virzītas nepārtrauktas izpildes vietām – tādu periodu vidējais ilgums, kuros netika sniegti cenu piedāvājumi	
Vidējais cenas piedāvājuma esības rādītājs	

9. tabula. Publicējamā informācija, kā minēts 8. pantā

Vidējais aritmētiskais laiks, kas pagājis starp pieņemšanu un izpildi	
Mediānais laiks, kas pagājis starp pieņemšanu un izpildi	
Vidējais aritmētiskais laiks, kas pagājis starp pieprasījumu un visu atbilstīgu cenu piedāvājumu sniegšanu	
Mediānais laiks, kas pagājis starp pieprasījumu un visu atbilstīgu cenu piedāvājumu sniegšanu	