Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiame dokumente pateikiamomis nuorodomis

►B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/587

2016 m. liepos 14 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais dėl akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių ir su pareiga tam tikrų akcijų sandorius vykdyti prekybos vietoje arba per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką

(Tekstas svarbus EĖE)

(OL L 87, 2017 3 31, p. 387)

iš dalies keičiamas:

		Oficialusis leidinys		
		Nr.	puslapis	data
►M1	2018 m. gruodžio 12 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/442	L 77	56	2019 3 20

▼B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/587

2016 m. liepos 14 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais dėl akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių ir su pareiga tam tikrų akcijų sandorius vykdyti prekybos vietoje arba per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką

(Tekstas svarbus EEE)

I SKIRSNIS

BENDROJI INFORMACIJA

1 straipsnis

Apibrėžtys

Šiame reglamente vartojamų terminų apibrėžtys:

1) prekyba portfeliais – penkių ar daugiau skirtingų finansinių priemonių sandoriai, kuriuos vienu metu ir kaip vieną lotą už konkrečią referencinę kainą vykdo tas pats klientas;

2) perduodamasis (angl. *give-up*) sandoris arba perimamasis (angl. *give-in*) sandoris – sandoris, kuriuo investicinė įmonė perduoda kliento sandorį kitai investicinei įmonei arba perima kliento sandorį iš kitos investicinės įmonės, kad jį sutvarkytų po sandorio sudarymo;

3) vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandoris – vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandoris, kaip apibrėžta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/577 3 straipsnio 6 dalyje;

4) sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas – investicinė įmonė, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2014/65/ES ([1]) 4 straipsnio 1 dalies 20 punkte.

2 straipsnis

Sandoriai, kuriais neprisidedama prie kainos susidarymo proceso

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 straipsnio 1 dalis)

Akcijų sandoriu neprisidedama prie kainos susidarymo proceso, esant kuriai nors iš šių aplinkybių:

a) sandoris vykdomas atsižvelgiant į kainą, kuri apskaičiuojama keliais laiko momentais pagal atitinkamą lyginamąjį indeksą, įskaitant

([1]) 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamos Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES (OL L 173, 2014 6 12, p. 349).

▼B

sandorius, įvykdytus atsižvelgiant į pagal apimtį įvertintą vidutinę kainą arba pagal laiką įvertintą vidutinę kainą;

▼M1

b) sandoris sudaro prekybos portfeliais dalį, kuri apima penkias ar daugiau skirtingų akcijų;

▼B

c) sandoris priklauso nuo išvestinės finansinės priemonės sandorio arba kitos finansinės priemonės įsigijimo, pardavimo, sukūrimo arba išpirkimo, kai visi sandorio komponentai bus vykdomi tik kaip vienas lotas;

d) sandorį vykdo valdymo įmonė, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/65/EB ([1]) 2 straipsnio 1 dalies b punkte, arba alternatyvaus investavimo fondo valdytojas, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2011/61/ES ([2]) 4 straipsnio 1 dalies b punkte, kurie perduoda vieno kolektyvinio investavimo subjekto tikrąją akcijų nuosavybę kitam, kai sandoryje nedalyvauja jokia investicinė įmonė;

e) sandoris yra perduodamasis sandoris arba perimamasis sandoris;

f) sandorio tikslas yra perduoti akcijas kaip įkaitą dvišaliuose sandoriuose arba taikant pagrindinės sandorio šalies garantinę įmoką arba įkaito reikalavimus, arba vykdant pagrindinės sandorio šalies įsipareigojimų neįvykdymo valdymo procesą;

g) sandorio rezultatas – akcijų pateikimas pasinaudojant konvertuojamomis obligacijomis, pasirinkimo sandoriais, padengtais varantais ar kitomis panašiomis išvestinėmis finansinėmis priemonėmis;

▼M1

_____

▼B

i) sandoris vykdomas pagal prekybos vietos, pagrindinės sandorio šalies arba centrinio vertybinių popierių depozitoriumo taisykles arba procedūras, siekiant atlikti neapmokėtų sandorių supirkimą pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 909/2014 ([3]).

([1]) 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32).

([2]) 2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/ES dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuria iš dalies keičiami direktyvos 2003/41/EB ir 2009/65/EB bei reglamentai (EB) Nr. 1060/2009 ir (ES) Nr. 1095/2010 (OL L 174, 2011 7 1, p. 1).

([3]) 2014 m. liepos 23 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 909/2014 dėl atsiskaitymo už vertybinius popierius gerinimo Europos Sąjungoje ir centrinių vertybinių popierių depozitoriumų, kuriuo iš dalies keičiamos direktyvos 98/26/EB ir 2014/65/ES bei Reglamentas (ES) Nr. 236/2012 (OL L 257, 2014 8 28, p. 1).

▼B

II SKYRIUS

SKAIDRUMAS IKI SANDORIO SUDARYMO

1 skirsnis

Prekybos vietų skaidrumas iki sandorio sudarymo

3 straipsnis

Skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 3 straipsnio 1 ir 2 dalys)

1. Rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, viešai skelbia pirkimo ir pardavimo kainų intervalą ir komercinio susidomėjimo tomis kainomis mastą. Informacija viešinama pagal jų valdomų prekybos sistemų tipą, kaip nustatyta I priedo 1 lentelėje.

▼M1

2. 1 dalyje nurodyti skaidrumo reikalavimai taip pat taikomi informaciniam pranešimui apie susidomėjimą, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 33 punkte ir laikantis to reglamento 3 straipsnio.

▼B

4 straipsnis

Likvidumo požiūriu labiausiai susijusi rinka

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a punktas)

1. Taikant Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a punktą, likvidumo požiūriu labiausiai susijusi akcijos, depozitoriumo pakvitavimo, biržinio fondo, sertifikato ar kitos panašios finansinės priemonės rinka laikoma prekybos vieta, kurios apyvarta prekiaujant ta finansine priemone yra didžiausia Sąjungoje.

2. Siekdamos nustatyti likvidumo požiūriu labiausiai susijusias rinkas pagal 1 dalį, kompetentingos institucijos, taikydamos 17 straipsnio 4 dalyje nustatytą metodiką, apskaičiuoja kiekvienos finansinės priemonės, kurios atžvilgiu jos yra kompetentingos institucijos, ir kiekvienos prekybos vietos, kurioje ta finansine priemone prekiaujama, apyvartą.

3. 2 dalyje nurodytas apskaičiavimas:

a) apima, kiekvienos prekybos vietos atveju, pagal tos prekybos vietos taisykles įvykdytus sandorius, išskyrus referencinės kainos ir suderėtus sandorius, pažymėtus, kaip nustatyta I priedo 4 lentelėje, ir sandorius, įvykdytus remiantis bent vienu pavedimu, kuriam netaikomi didelės apimties reikalavimai ir sandorio dydis viršija taikytiną didelio pavedimo ribą, nustatytą pagal 7 straipsnį;

▼B

b) apima prieš tai ėjusius kalendorinius metus arba, kai taikytina, prieš tai ėjusių kalendorinių metų laikotarpį, kuriuo ta finansine priemone buvo leista prekiauti arba prekiauta prekybos vietoje ir kuriuo prekyba ja nebuvo sustabdyta.

4. Kol laikantis 1–3 dalyse nurodytos tvarkos bus nustatyta likvidumo požiūriu labiausiai susijusi konkrečios finansinės priemonės rinka, likvidumo požiūriu labiausiai susijusi rinka bus prekybos vieta, kurioje buvo pirmą kartą leista prekiauti arba pirmą kartą įvyko prekyba ta finansine priemone.

5. 2 ir 3 dalys netaikomos akcijoms, depozitoriumo pakvitavimams, biržiniams fondams, sertifikatams ir kitoms panašioms finansinėms priemonėms, kuriais pirmą kartą leista prekiauti arba pirmą kartą įvyko prekyba prekybos vietoje keturias ar mažiau savaičių iki prieš tai ėjusių kalendorinių metų pabaigos.

5 straipsnis

Suderėtų sandorių ypatumai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies b punktas)

Akcijų, depozitoriumo pakvitavimo, biržinio fondo, sertifikato ir kitos panašios finansinės priemonės suderėtas sandoris laikomas sandoriu, dėl kurio suderėta privačiai, bet apie jį pranešta pagal prekybos vietos taisykles, esant kuriai nors iš šių aplinkybių:

a) du tos prekybos vietos nariai arba dalyviai dalyvauja kuriuo nors iš toliau nurodytų būdų:

   i) vienas prekiauja savo sąskaita, o kitas veikia kliento vardu;

   ii) abu prekiauja savo sąskaita;

   iii) abu veikia kliento vardu;

b) vienas tos prekybos vietos narys arba dalyvis veikia vienų iš toliau nurodytų būdų:

   i) veikia tiek pirkėjo, tiek pardavėjo vardu;

   ii) prekiauja savo sąskaita pagal kliento pavedimą.

6 straipsnis

Suderėti sandoriai, kuriems taikomos kitos sąlygos, nei esama rinkos kaina

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies b punktas)

Akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių suderėtam sandoriui taikomos kitos sąlygos, nei tos finansinės priemonės esama rinkos kaina, esant kuriai nors iš šių aplinkybių:

a) sandoris vykdomas atsižvelgiant į kainą, kuri apskaičiuojama keliais laiko momentais pagal atitinkamą lyginamąjį indeksą, įskaitant sandorius, įvykdytus atsižvelgiant į pagal apimtį įvertintą vidutinę kainą arba pagal laiką įvertintą vidutinę kainą;

▼B

b) sandoris sudaro prekybos portfeliais dalį;

c) sandoris priklauso nuo išvestinės finansinės priemonės sandorio arba kitos finansinės priemonės įsigijimo, pardavimo, sukūrimo arba išpirkimo, kai visi sandorio komponentai turi būti vykdomi kaip vienas lotas;

d) sandorį vykdo valdymo įmonė, kaip apibrėžta Direktyvos 2009/65/EB 2 straipsnio 1 dalies b punkte, arba alternatyvaus investavimo fondo valdytojas, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies b punkte, kurie perduoda vieno kolektyvinio investavimo subjekto tikrąją finansinių priemonių nuosavybę kitam, kai sandoryje nedalyvauja jokia investicinė įmonė;

e) sandoris yra perduodamasis sandoris arba perimamasis sandoris;

f) sandorio tikslas yra perduoti finansines priemones kaip įkaitą dvišaliuose sandoriuose arba taikant pagrindinės sandorio šalies garantinę įmoką arba įkaito reikalavimus, arba vykdant pagrindinės sandorio šalies įsipareigojimų neįvykdymo valdymo procesą;

g) sandorio rezultatas – finansinių priemonių pateikimas pasinaudojant konvertuojamomis obligacijomis, pasirinkimo sandoriais, padengtais varantais ar kita panašia išvestine finansine priemone;

▼M1

_____

▼B

i) sandoris vykdomas pagal prekybos vietos, pagrindinės sandorio šalies arba centrinio vertybinių popierių depozitoriumo taisykles arba procedūras, siekiant atlikti neapmokėtų sandorių supirkimą pagal Reglamentą (ES) Nr. 909/2014;

j) bet koks kitas sandoris, lygiavertis vienam iš aprašytųjų a–i punktuose, nes priklauso nuo techninių ypatybių, kurios nesusijusios su prekiaujamos finansinės priemonės esama rinkos verte.

7 straipsnis

Didelės apimties pavedimai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies c punktas)

1. Pavedimas, susijęs su akcija, depozitoriumo pakvitavimu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone, laikomas esančiu didelės apimties, kai jis prilygsta minimalaus dydžio pavedimui, kaip nustatyta II priedo 1 ir 2 lentelėse, arba yra už jį didesnis.

2. Pavedimas, susijęs su biržiniu fondu, laikomas esančiu didelės apimties, kai jis prilygsta 1 000 000 EUR arba yra didesnis negu ta suma.

3. Siekdamos nustatyti didelės apimties pavedimus kompetentingos institucijos pagal 4 dalį apskaičiuoja vidutinę akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kuriais prekiaujama prekybos vietoje, dienos apyvartą.

▼B

4. 3 dalyje nurodytas apskaičiavimas:

a) apima finansinės priemonės, kuria prekiaujama prekybos vietoje arba ne prekybos vietoje, sandorius, įvykdytus Sąjungoje;

b) apima laikotarpį, prasidedantį prieš tai ėjusių kalendorinių metų sausio 1 d. ir pasibaigiantį prieš tai ėjusių kalendorinių metų gruodžio 31 d., arba, kai taikytina, tą kalendorinių metų dalį, kai finansine priemone buvo leista prekiauti arba prekiauta prekybos vietoje ir kai prekyba ja nebuvo sustabdyta.

3 ir 4 dalys netaikomos akcijoms, depozitoriumo pakvitavimams, sertifikatams ir kitoms panašioms finansinėms priemonėms, kuriais pirmą kartą leista prekiauti arba pirmą kartą įvyko prekyba prekybos vietoje keturias ar mažiau savaičių iki prieš tai ėjusių kalendorinių metų pabaigos.

5. Nebent būtų iš dalies pakeista kaina ar kitos svarbios pavedimo vykdymo sąlygos, Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalyje nurodytas leidimas netaikyti reikalavimų toliau galioja pavedimui, kuris yra didelės apimties įrašymo į pavedimų knygą metu, bet iš dalies jį įvykdžius sumažėja tiek, kad nebeviršija tai finansinei priemonei taikomos ribos, nustatytos 1 ir 2 dalyse.

6. Prieš pirmą kartą įvykstant prekybai akcija, depozitoriumo pakvitavimu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone prekybos vietoje Sąjungoje, kompetentinga institucija įvertina tos finansinės priemonės vidutinę dienos apyvartą, atsižvelgdama į bet kokią tos finansinės priemonės ir kitų finansinių priemonių, laikomų turinčiomis panašių ypatybių, prekybos istoriją, ir užtikrina šio įverčio paskelbimą.

7. 6 dalyje nurodytas vidutinės dienos apyvartos įvertis naudojamas apskaičiuojant didelės apimties pavedimus šešių savaičių laikotarpiu po to, kai akcija, depozitoriumo pakvitavimu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone buvo leista prekiauti arba pirmą kartą įvyko prekyba prekybos vietoje.

8. Kompetentinga institucija, remdamasi pirmų keturių prekybos savaičių duomenimis, apskaičiuoja vidutinę dienos apyvartą ir užtikrina jos paskelbimą iki 7 dalyje nurodyto šešių savaičių laikotarpio pabaigos.

9. 8 dalyje nurodyta vidutinė dienos apyvarta naudojama didelės apimties pavedimams apskaičiuoti iki tol, kol bus pradėta taikyti pagal 3 dalį apskaičiuota vidutinė dienos apyvarta.

10. Taikant šį straipsnį, vidutinė dienos apyvarta apskaičiuojama padalijant visą tos finansinės priemonės apyvartą, nurodytą 17 straipsnio 4 dalyje, iš atitinkamo laikotarpio prekybos dienų skaičiaus. Atitinkamo laikotarpio prekybos dienų skaičius yra tos finansinės priemonės likvidumo požiūriu labiausiai susijusios rinkos, kaip nustatyta pagal 4 straipsnį, prekybos dienų skaičius.

▼B

8 straipsnis

Pavedimų, laikomų pavedimų tvarkymo sistemoje, rūšis ir minimalus dydis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies d punktas)

1. Prekybos vietos pavedimų tvarkymo sistemoje iki informacijos atskleidimo laikomas pavedimas, kuriam galima netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigų, yra pavedimas:

a) kurį ketinama atskleisti prekybos vietos vedamoje pavedimų knygoje ir kuris priklauso nuo objektyvių sąlygų, iš anksto nulemtų sistemos protokolu;

b) kuris negali sąveikauti su kitais prekybos interesais prieš jį atskleidžiant prekybos vietos vedamoje pavedimų knygoje;

c) kuris, jį atskleidus pavedimų knygoje, sąveikauja su kitais pavedimais pagal atskleidimo metu tos rūšies pavedimams taikomas taisykles.

2. Prekybos vietos pavedimų tvarkymo sistemoje iki informacijos atskleidimo laikomi pavedimai, kuriems galima netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigų, įrašymo metu ir atlikus kokį nors pakeitimą yra vieno iš šių dydžių:

a) rezervinio pavedimo atveju – 10 000 EUR arba didesnis;

b) visų kitų pavedimų atvejais – lygus minimaliam prekiaujamam kiekiui, kurį iš anksto nustatė sistemos operatorius pagal savo taisykles ir protokolus, arba didesnis.

3. 2 dalies a punkte minimu rezerviniu pavedimu laikomas limituotas pavedimas, kurį sudaro atskleistas pavedimas, susijęs su kiekio dalimi, ir neatskleistas pavedimas, susijęs su likusiu kiekiu, kai neatskleistas kiekis gali būti tinkamas vykdyti tik po to, kai jis paskelbiamas pavedimų knygoje kaip naujas atskleistas pavedimas.

2 skirsnis

Sistemingai sandorius savo viduje sudarančių tarpininkų ir investicinių įmonių, prekiaujančių ne prekybos vietoje, skaidrumas iki sandorio sudarymo

9 straipsnis

Tvirtosios kotiruotės skelbimo tvarka

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 14 straipsnio 1 dalis)

Bet kokia tvarka, kurią priima sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas, siekdamas vykdyti pareigą viešai skelbti tvirtąsias kotiruotes, atitinka tokias sąlygas:

a) tvarka apima visus pagrįstus veiksmus, būtinus užtikrinti viešai skelbtinos informacijos patikimumą, nuolatinę stebėseną, kad nebūtų klaidų, ir pastebėtų klaidų ištaisymą nedelsiant;

▼B

b) tvarka atitinka technines priemones, kurios yra lygiavertės nustatytosioms patvirtintiems skelbimo subjektams (PSS) Deleguotojo reglamento (ES) 2017/571 15 straipsnyje ir kurios padeda konsoliduoti duomenis su panašiais duomenimis iš kitų šaltinių;

c) dėl šios tvarkos informacija yra visuomenei prieinama nediskriminuojant;

d) pagal šią tvarką numatoma paskelbti laiką, kada kotiruotės buvo įvestos arba pakeistos, pagal Direktyvos 2014/65/ES 50 straipsnį, kaip patikslinta Komisijos deleguotajame reglamente (ES) 2017/574 ([1]).

▼M1

10 straipsnis

Vyraujančias rinkos sąlygas atspindinčios kainos

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 14 straipsnio 3 dalis)

Laikoma, kad sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko paskelbtos kainos atitinka vyraujančias rinkos sąlygas, kai paskelbimo metu jos yra artimos tos pačios finansinės priemonės lygiaverčio dydžio kotiruotei likvidumo požiūriu labiausiai susijusioje tos finansinės priemonės rinkoje, kaip nustatyta pagal 4 straipsnį.

Tačiau laikoma, kad sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko paskelbtos akcijų ir depozitoriumo pakvitavimų kainos atitinka vyraujančias rinkos sąlygas tik tuomet, kai tos kainos atitinka šio straipsnio pirmoje pastraipoje nurodytus reikalavimus ir jas skelbiant paisoma minimalaus kainos padidėjimo, atitinkančio kainos pokyčio dydį, nurodytą Komisijos deleguotojo reglamento (ES) Nr. 2017/588 ([2]) 2 straipsnyje.

▼B

11 straipsnis

Standartinis rinkos dydis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 14 straipsnio 2 ir 4 dalys)

1. Akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kurių rinka yra likvidi, standartinis rinkos dydis nustatomas remiantis kiekvienos finansinės priemonės sandorių vidutine verte, apskaičiuota pagal 2 ir 3 dalis ir pagal II priedo 3 lentelę.

2. Siekdamos nustatyti standartinį rinkos dydį, taikomą konkrečiai finansinei priemonei, kaip nustatyta 1 dalyje, kompetentingos institucijos apskaičiuoja visų akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kuriais prekiaujama prekybos vietoje, kurių rinka yra likvidi ir kurių atžvilgiu jos yra kompetentingos institucijos, sandorių vidutinę vertę.

([1]) 2016 m. birželio 7 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/574, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma verslo laikrodžių tikslumo lygio techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 148).

([2]) 2016 m. liepos 14 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/588, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su kainos pokyčio dydžio tvarka, taikoma akcijoms, depozitoriumo pakvitavimams ir biržiniams fondams (OL L 87, 2017 3 31, p. 411).

▼B

3. 2 dalyje nurodytas apskaičiavimas:

a) apima Sąjungoje įvykdytus susijusios finansinės priemonės sandorius, nepriklausomai nuo to, ar jie buvo įvykdyti prekybos vietoje, ar ne;

b) apima prieš tai ėjusius kalendorinius metus arba, kai taikytina, prieš tai ėjusių kalendorinių metų laikotarpį, kuriuo finansine priemone leista prekiauti arba prekiauta prekybos vietoje ir kuriuo prekyba ja nebuvo sustabdyta;

c) neapima didelės apimties sandorių po sandorio sudarymo, kaip nustatyta I priedo 4 lentelėje.

2 ir 3 dalys netaikomos akcijoms, depozitoriumo pakvitavimams, sertifikatams ir kitoms panašioms finansinėms priemonėms, kuriais pirmą kartą leista prekiauti arba prekyba pirmą kartą įvyko prekybos vietoje keturias ar mažiau savaičių iki prieš tai ėjusių kalendorinių metų pabaigos.

▼M1

4. Prieš pirmą kartą įvykstant prekybai akcija, depozitoriumo pakvitavimu, biržiniu fondu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone prekybos vietoje Sąjungoje, kompetentinga institucija įvertina tos finansinės priemonės vidutinę sandorių vertę, atsižvelgdama į bet kokią tos finansinės priemonės ir kitų finansinių priemonių, laikomų turinčiomis panašių ypatybių, prekybos istoriją, ir užtikrina šio įverčio paskelbimą.

5. 4 dalyje nurodytas vidutinės sandorių vertės įvertis naudojamas nustatant akcijos, depozitoriumo pakvitavimo, biržinio fondo, sertifikato ar kitos panašios finansinės priemonės standartinį rinkos dydį šešių savaičių laikotarpiu po to, kai akcija, depozitoriumo pakvitavimu, biržiniu fondu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone buvo leista prekiauti arba pirmą kartą įvyko prekyba prekybos vietoje.

▼B

6. Kompetentinga institucija, remdamasi pirmų keturių prekybos savaičių duomenimis, apskaičiuoja vidutinę sandorių vertę ir užtikrina jos paskelbimą iki 5 dalyje nurodyto šešių savaičių laikotarpio pabaigos.

7. 6 dalyje nurodyta vidutinė sandorių vertė taikoma iš karto po jos paskelbimo ir iki tol, kol bus pradėta taikyti nauja vidutinė sandorių vertė, apskaičiuota pagal 2 ir 3 dalis.

8. Taikant šį straipsnį, vidutinė sandorių vertė apskaičiuojama padalijant visą tos finansinės priemonės apyvartą, nurodytą 17 straipsnio 4 dalyje, iš viso per atitinkamą laikotarpį įvykdytų tos finansinės priemonės sandorių skaičiaus.

▼B

III SKYRIUS

PREKYBOS VIETŲ IR INVESTICINIŲ ĮMONIŲ, PREKIAUJANČIŲ NE PREKYBOS VIETOJE, SKAIDRUMAS PO SANDORIO SUDARYMO

12 straipsnis

Skaidrumo po sandorio sudarymo pareigos

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 6 straipsnio 1 dalis ir 20 straipsnio 1 ir 2 dalys)

1. Rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, ir investicinės įmonės, prekiaujančios ne pagal prekybos vietos taisykles, viešai skelbia informaciją apie kiekvieną sandorį, naudodami I priedo 2, 3 ir 4 informacines lenteles.

2. Kai anksčiau paskelbtas prekybos pranešimas anuliuojamas, investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, ir rinkos operatoriai bei investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, viešai skelbia naują prekybos pranešimą, kuriame pateikiama visa pirminio prekybos pranešimo informacija ir anuliavimo žyma, nurodyta I priedo 4 lentelėje.

3. Kai anksčiau paskelbtas prekybos pranešimas iš dalies pakeičiamas, rinkos operatoriai bei investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, ir investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, viešai skelbia tokią informaciją:

a) naują prekybos pranešimą, kuriame pateikiama visa pirminio prekybos pranešimo informacija ir anuliavimo žyma, nurodyta I priedo 4 lentelėje;

b) naują prekybos pranešimą, kuriame pateikiama visa pirminio prekybos pranešimo informacija bei visa reikalinga pataisyta informacija ir pakeitimo žyma, nurodyta I priedo 4 lentelėje.

4. Kai sandoris tarp dviejų investicinių įmonių sudaromas ne pagal prekybos vietos taisykles, tiek savo sąskaita, tiek klientų vardu, tik atitinkamą finansinę priemonę parduodanti investicinė įmonė viešai paskelbia apie sandorį per PSS.

5. Nukrypstant nuo 4 dalies, kai tik viena iš konkrečios finansinės priemonės sandorio šalių yra sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas ir jis yra perkančioji įmonė, tik ta įmonė viešai paskelbia apie sandorį per PSS ir informuoja pardavėją apie savo veiksmus.

6. Investicinės įmonės imasi visų pagrįstų žingsnių, siekdamos užtikrinti, kad apie sandorį būtų viešai skelbiama kaip apie vieną sandorį. Šiam tikslui du suderinti prekybos sandoriai, vienu metu ir už tą pačią kainą sudaryti su viena šalimi tarpininke, laikomi vienu sandoriu.

▼B

13 straipsnis

Skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymas tam tikrų rūšių sandoriams, įvykdytiems ne prekybos vietoje

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 20 straipsnio 1 dalis)

Reglamento (ES) Nr. 600/2014 20 straipsnio 1 dalyje nustatyta pareiga netaikoma:

a) sandoriams, išvardytiems Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 ([1]) 2 straipsnio 5 dalyje, kai taikoma;

b) sandoriams, kuriuos vykdo valdymo įmonė, kaip apibrėžta Direktyvos 2009/65/EB 2 straipsnio 1 dalies b punkte, arba alternatyvaus investavimo fondo valdytojas, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies b punkte, kurie perduoda vieno kolektyvinio investavimo subjekto tikrąją finansinių priemonių nuosavybę kitam, kai sandoryje nedalyvauja jokia investicinė įmonė;

c) perduodamiesiems sandoriams ir perimamiesiems sandoriams;

d) perduodant finansines priemones kaip įkaitą dvišaliuose sandoriuose arba taikant pagrindinės sandorio šalies garantinę įmoką arba įkaito reikalavimus, arba vykdant pagrindinės sandorio šalies įsipareigojimų neįvykdymo valdymo procesą.

14 straipsnis

Sandorių skelbimas realiuoju laiku

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 6 straipsnio 1 dalis)

1. Po sandorio sudarymo turima informacija apie sandorius, kurie įvyko konkrečioje prekybos vietoje, skelbiama viešai tokiomis aplinkybėmis:

a) kai sandoris vykdomas prekybos vietos prekybos dienos valandomis, praėjus kuo mažiau laiko nuo sandorio sudarymo momento, kiek tai techniškai įmanoma, ir bet kokiu atveju per vieną minutę po atitinkamo sandorio;

b) kai sandoris vykdomas ne prekybos vietos prekybos dienos valandomis, prieš prasidedant kitai tos prekybos vietos prekybos dienai.

([1]) 2016 m. liepos 28 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/590, kuriuo Reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas pranešimo apie sandorius kompetentingoms institucijoms techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 449).

▼B

2. Po sandorio sudarymo turima informacija apie sandorius, kurie įvyko ne prekybos vietoje, skelbiama viešai tokiomis aplinkybėmis:

a) kai sandoris įvykdomas atitinkamos akcijos, depozitoriumo pakvitavimo, biržinio fondo, sertifikato ar kitos panašios finansinės priemonės likvidumo požiūriu labiausiai susijusios rinkos, nustatytos pagal 4 straipsnį, prekybos dienos valandomis arba investicinės įmonės prekybos dienos valandomis, praėjus kuo mažiau laiko nuo sandorio sudarymo momento, kiek tai techniškai įmanoma, ir bet kokiu atveju per vieną minutę po atitinkamo sandorio;

b) kai sandoris įvykdomas bet kokiu atveju, kuris nenurodytas a punkte, vos prasidėjus investicinės įmonės prekybos dienos valandoms ir ne vėliau kaip prieš likvidumo požiūriu labiausiai susijusios rinkos, nustatytos pagal 4 straipsnį, kitos prekybos dienos pradžią.

3. Su prekyba portfeliais susijusi informacija apie kiekvieną sudėtinį sandorį yra skelbiama viešai praėjus kuo mažiau laiko nuo sandorio sudarymo momento, kiek tai techniškai įmanoma, atsižvelgiant į poreikį priskirti kainas prie konkrečių akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių. Kiekvienas sudėtinis sandoris vertinamas atskirai, siekiant nustatyti, ar pagal 15 straipsnį taikytinas informacijos apie šį sandorį skelbimo atidėjimas.

15 straipsnis

Atidėtas sandorių skelbimas

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 7 straipsnio 1 dalis ir 20 straipsnio 1 ir 2 dalys)

1. Kai kompetentinga institucija suteikia leidimą atidėti sandorių duomenų skelbimą pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 7 straipsnio 1 dalį, rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, ir investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, viešai paskelbia kiekvieno sandorio duomenis ne vėliau kaip II priedo 4, 5 ir 6 lentelėse nustatyto atitinkamo laikotarpio pabaigoje, su sąlyga, kad atitinkami šie kriterijai:

a) sandorį sudarė investicinė įmonė, prekiaujanti savo sąskaita, išskyrus tarpininko suderintus sandorius, ir kita sandorio šalis;

b) sandorio dydis yra lygus atitinkamam mažiausiam dydžiui, nustatytam II priedo 4, 5 arba 6 lentelėje, arba jį viršija, priklausomai nuo atvejo.

2. Taikant 1 dalies b punktą, atitinkamas mažiausias dydis nustatomas pagal vidutinę dienos apyvartą, apskaičiuojamą, kaip nustatyta 7 straipsnyje.

3. Kai sandorių duomenų skelbimą leista atidėti iki prekybos dienos pabaigos, kaip nustatyta II priedo 4, 5 ir 6 lentelėse, investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, ir rinkos operatoriai

▼B

bei investicinės įmonės, valdantys prekybos vietą, tų sandorių duomenis viešai skelbia:

a) praėjus kuo mažiau laiko nuo prekybos dienos pabaigos, kuri kai taikoma, apima ir baigiamąjį aukcioną, kai sandoriai įvykdyti daugiau nei prieš dvi valandas iki prekybos dienos pabaigos;

b) ne vėliau kaip kitos prekybos dienos vidurdienį vietos laiku, kai sandoriai nepaminėti a punkte.

Kai sandoriai vykdomi ne prekybos vietoje, nuorodos į prekybos dienas ir baigiamuosius aukcionus yra nuorodos į likvidumo požiūriu labiausiai susijusios rinkos, kaip nustatyta pagal 4 straipsnį, prekybos dienas ir baigiamuosius aukcionus.

4. Kai dviejų investicinių įmonių sudarytas sandoris vykdomas ne pagal prekybos vietos taisykles, kompetentinga institucija, nustatanti taikomą atidėjimo tvarką, yra investicinės įmonės, atsakingos už sandorio paskelbimą per PSS pagal 12 straipsnio 5 ir 6 dalis, kompetentinga institucija.

16 straipsnis

Nuorodos į prekybos dieną ir prekybos dienos valandas

1. Kalbant apie prekybos vietą, nuoroda į prekybos dieną yra nuoroda į bet kokią dieną, kuri yra tos prekybos vietos darbo diena, kurią vykdoma prekyba.

2. Nuoroda į prekybos vietos arba investicinės įmonės prekybos dienos valandas yra nuoroda į valandas, kurias iš anksto nustato prekybos vieta arba investicinė įmonė ir paskelbia kaip savo prekybos valandas.

3. Nuoroda į prekybos dienos pradžią konkrečioje prekybos vietoje yra nuoroda į tos prekybos vietos prekybos dienos valandų pradžią.

4. Nuoroda į prekybos dienos pabaigą konkrečioje prekybos vietoje yra nuoroda į tos prekybos vietos prekybos dienos valandų pabaigą.

IV SKYRIUS

BENDROS SU SKAIDRUMU IKI SANDORIO SUDARYMO IR PO SANDORIO SUDARYMO SUSIJUSIO SKAIČIAVIMO NUOSTATOS

17 straipsnis

Su skaidrumu susijusio skaičiavimo metodika, skelbimo data ir taikymo data

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 22 straipsnio 1 dalis)

1. Ne vėliau kaip praėjus 14 mėnesių nuo Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos ir iki kiekvienų paskesnių metų kovo 1 d. kompetentingos institucijos surenka informaciją apie kiekvieną finansinę priemonę, kurios atžvilgiu ji yra kompetentinga institucija, atlieka skaičiavimus ir užtikrina, kad būtų paskelbta tokia informacija:

a) prekybos vieta, kuri yra likvidumo požiūriu labiausiai susijusi rinka, kaip nustatyta 4 straipsnio 2 dalyje;

▼B

b) vidutinė dienos apyvarta, pagal kurią nustatomas didelės apimties pavedimų dydis, kaip nustatyta 7 straipsnio 3 dalyje;

c) vidutinė sandorių vertė, pagal kurią nustatomas standartinis rinkos dydis, kaip nustatyta 11 straipsnio 2 dalyje.

▼M1

2. Kompetentingos institucijos, rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, įskaitant investicines įmones, valdančias prekybos vietą, naudoja pagal 1 dalį paskelbtą informaciją nuo tų metų, kuriais ši informacija paskelbta, balandžio 1 d.

▼B

3. Kompetentingos institucijos užtikrina, kad taikant Reglamentą (ES) Nr. 600/2014 pagal 1 dalį viešai skelbiama informacija būtų reguliariai atnaujinama ir kad visi pakeitimai, susiję su konkrečia akcija, depozitoriumo pakvitavimu, biržiniu fondu, sertifikatu ar kita panašia finansine priemone ir turintys didelės įtakos ankstesniems skaičiavimams ir paskelbtai informacijai, būtų įtraukti į tokią atnaujintą informaciją.

4. Norint atlikti 1 dalyje nurodytus skaičiavimus, su finansine priemone susijusi apyvarta apskaičiuojama sudedant rezultatus, gautus padauginus kiekvieno per nustatytą laikotarpį įvykdyto sandorio tos priemonės, kuria apsikeičia pirkėjai ir pardavėjai, vienetų skaičių iš tokiam sandoriui taikomos vieneto kainos.

5. Pasibaigus prekybos dienai, bet iki dienos pabaigos prekybos vietos pateikia kompetentingoms institucijoms III priedo 1 ir 2 lentelėse nustatytus duomenis, kai finansine priemone leista prekiauti arba prekyba pirmą kartą įvyko prekybos vietoje arba kai tie anksčiau pateikti duomenys pasikeitė.

18 straipsnis

Nuoroda į kompetentingas institucijas

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 22 straipsnio 1 dalis)

Konkrečios finansinės priemonės atžvilgiu kompetentinga institucija, atsakinga už skaičiavimų atlikimą ir užtikrinimą, kad būtų paskelbta 4, 7, 11 ir 17 straipsniuose nurodyta informacija, yra likvidumo požiūriu labiausiai susijusios rinkos kompetentinga institucija, nustatyta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 26 straipsnyje ir Deleguotojo reglamento (ES) 2017/571 16 straipsnyje.

19 straipsnis

Pereinamojo laikotarpio nuostatos

1. Nukrypdamos nuo 17 straipsnio 1 dalies kompetentingos institucijos renka duomenis, atlieka skaičiavimus ir užtikrina jų paskelbimą vos tik juos užbaigus, laikydamosi tokių terminų:

▼B

a) kai data, kada prekyba finansinėmis priemonėmis pirmą kartą įvyko prekybos vietoje Sąjungoje, yra ne mažiau kaip dešimt savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos, kompetentingos institucijos skaičiavimų rezultatus paskelbia ne vėliau kaip prieš keturias savaites iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios;

b) kai data, kada prekyba finansinėmis priemonėmis pirmą kartą įvyko prekybos vietoje Sąjungoje, yra kuri nors laikotarpio, kuris prasideda dešimt savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos ir baigiasi dieną prieš pradedant taikyti Reglamentą (ES) Nr. 600/2014, data, kompetentingos institucijos skaičiavimų rezultatus paskelbia ne vėliau kaip Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dieną.

2. 1 dalyje nurodyti skaičiavimai atliekami taip:

a) kai data, kada prekyba finansinėmis priemonėmis pirmą kartą įvyko prekybos vietoje Sąjungoje, yra ne mažiau kaip šešiolika savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos, skaičiavimai grindžiami turimais keturiasdešimties savaičių ataskaitinio laikotarpio, kuris prasideda penkiasdešimt dvi savaitės iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos, duomenimis;

b) kai data, kada prekyba finansinėmis priemonėmis pirmą kartą įvyko prekybos vietoje Sąjungoje, yra kuri nors laikotarpio, kuris prasideda šešiolika savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos ir baigiasi dešimt savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos, data, skaičiavimai grindžiami turimais tos finansinės priemonės keturių pirmų prekybos savaičių duomenimis;

c) kai data, kada prekyba finansinėmis priemonėmis pirmą kartą įvyko prekybos vietoje Sąjungoje, yra kuri nors laikotarpio, kuris prasideda dešimt savaičių iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos ir baigiasi dieną prieš pradedant taikyti Reglamentą (ES) Nr. 600/2014, data, skaičiavimai grindžiami prekybos tomis finansinėmis priemonėmis arba kitomis finansinėmis priemonėmis, laikomomis turinčiomis panašių ypatybių, ankstesniais istoriniais duomenimis.

3. Penkiolikos mėnesių laikotarpiu nuo Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios datos kompetentingos institucijos, rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, įskaitant investicines įmones, valdančias prekybos vietą, pagal 1 dalį paskelbtą informaciją to reglamento 4 straipsnio 1 dalies a ir c punktų ir 14 straipsnio 2 ir 4 dalių tikslais.

4. 3 dalyje nurodytu laikotarpiu kompetentingos institucijos 2 dalies b ir c punktuose nurodytų finansinių priemonių atžvilgiu užtikrina:

a) kad pagal 1 dalį skelbiama informacija tebebūtų tinkama Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a ir c punkto ir 14 straipsnio 2 ir 4 dalių taikymo tikslams;

▼B

b) kad pagal 1 dalį skelbiama informacija, kai reikia, būtų atnaujinama atsižvelgiant į ilgesnį prekybos laikotarpį ir išsamesnę prekybos istoriją.

20 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

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

Jis taikomas nuo 2018 m. sausio 3 d.

Tačiau 19 straipsnis taikomas nuo šio reglamento įsigaliojimo dienos.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

▼B

I PRIEDAS

Viešai skelbtina informacija

1 lentelė

Prekybos sistemų rūšių ir susijusios informacijos, skelbiamos viešai pagal 3 straipsnį, aprašymas

Prekybos sistemos rūšis	Prekybos sistemos aprašymas	Viešai skelbtina informacija
Nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono prekybos sistema	Sistema, kuri pagal pavedimų knygą ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo, remdamasi geriausia turima kaina, nenutrūkstamai derina pavedimus parduoti su pavedimais pirkti.	Bendras pavedimų ir akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kurias jie pakeičia kiekvienu kainų lygiu, skaičius, nurodant ne mažiau kaip penkis geriausius pirkimo ir pardavimo kainų lygius.
Kotiravimu pagrįsta prekybos sistema	Sistema, kurioje sandoriai vykdomi remiantis tvirtosiomis kotiruotėmis, kurios nepertraukiamai skelbiamos dalyviams; o tam rinkos formuotojai turi išlaikyti kotiruotes tokio lygio, kad būtų subalansuoti narių ir dalyvių poreikiai, kad jie galėtų atlikti komercinės apimties sandorius, ir rinkos formuotojams galima rizika.	Geriausia kiekvieno rinkos formuotojo akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama prekybos sistemoje, pirkimo ir pardavimo kaina, kartu nurodant su tomis kainomis susijusią apimtį. Viešai skelbiamos kotiruotės – tai tos kainos, kurios atspindi saistančius įsipareigojimus pirkti ir parduoti finansines priemones bei nurodo finansinių priemonių, kurias registruotieji rinkos formuotojai yra pasirengę nupirkti ar parduoti, kainą ir apimtį. Tačiau neįprastomis rinkos sąlygomis ribotą laikotarpį gali būti leidžiamos tik orientacinės, tik pasiūlos arba tik paklausos kainos.
Reguliaraus pavedimų knygos aukciono prekybos sistema	Sistema, kuri derina pavedimus pagal reguliarų aukcioną ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo.	Kaina, pagal kurią aukciono prekybos sistema geriausiai atitiktų savo prekybos algoritmą akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ir kitų panašių finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama prekybos sistemoje, atžvilgiu ir apimtį, kurią tos sistemos dalyviai galėtų įvykdyti ta kaina.
Prašymų dėl kotiruočių prekybos sistema	Prekybos sistema, pagal kurią kotiruotė arba kotiruotės pateikiamos reaguojant į vieno arba kelių narių ar dalyvių pateiktą prašymą dėl kotiruotės. Kotiruotę vykdo išskirtinai prašantysis narys arba dalyvis. Prašantysis narys arba dalyvis gali sudaryti sandorį priimdamas jo prašymu jam pateiktą kotiruotę arba kotiruotes.	Bet kurio nario arba dalyvio pateiktos kotiruotės ir susijusi apimtis, kurias priėmus būtų sudarytas sandoris pagal sistemos taisykles. Visos kotiruotės, pateiktos pagal prašymą dėl kotiruočių, gali būti skelbiamos vienu metu, bet ne vėliau nei tada, kai jos tampa vykdytinomis.

▼B

Prekybos sistemos rūšis	Prekybos sistemos aprašymas	Viešai skelbtina informacija
Bet kuri kita prekybos sistema	Bet kurios kitos rūšies prekybos sistema, įskaitant hibridinę, kuri apima dvi ar daugiau iš šioje lentelėje nurodytų prekybos sistemų rūšių.	Atitinkama informacija apie pavedimų arba kotiruočių ir komercinio susidomėjimo akcijomis, depozitoriumo pakvitavimais, biržiniais fondais, sertifikatais ir kitomis panašiomis finansinėmis priemonėmis, kuriomis prekiaujama prekybos sistemoje, lygius; visų pirma nurodant penkis geriausius pasiūlytus pirkimo ir pardavimo kainų lygius ir (arba) kiekvieno rinkos formuotojo kotiruojamas tos priemonės pirkimo ir pardavimo kainas, jeigu tą leidžia daryti kainos susidarymo mechanizmas.

2 lentelė

3 lentelės simbolių lentelė

Simbolis	Duomenų rūšis	Apibrėžtis
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitmeninių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{CURRENCYCODE_3}	3 raidiniai skaitiniai ženklai	Triraidis ISO 4217 valiutos kodas.
{DATE_TIME_ FORMAT}	ISO 8601 datos ir laiko formatas	Data ir laikas šiuo formatu: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. — YYYY – metai; — MM – mėnuo; — DD – diena; — T – reikia įrašyti raidę T; — hh – valanda; — mm – minutė; — ss.dddddd – sekundė ir sekundės dalis; — Z – suderintasis pasaulinis laikas.Datos ir laikai pateikiami suderintuoju pasauliniu laiku (UTC).
{DECIMAL-n/m}	Dešimtainis skaičius iš viso iki n skaitmenų, iš kurių iki m skaitmenų gali rodyti dalis	Skaičiaus laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės. — dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku); — neigiami skaičiai nurodomi su „–“ (minusu); Atitinkamais atvejais vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{ISIN}	12 raidiniai skaitiniai ženklai	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.

▼B

3 lentelė

Informacijos sąrašas skaidrumo po sandorio sudarymo tikslais

Laukelio identifikatorius	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pildytinas formatas, apibrėžtas 2 lentelėje
Prekybos data ir laikas	Data ir laikas, kada buvo įvykdytas sandoris. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis atitinka reikalavimus, nustatytus Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 2 straipsnyje. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju data ir laikas, kada šalys susitaria dėl toliau nurodytų laukelių turinio: kiekio, kainos, valiutų 31, 34 ir 44 laukeliuose, kaip nustatyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 1 priedo 2 lentelėje, priemonės identifikavimo kodo, priemonės klasifikacijos ir pagrindinės priemonės kodo, kai taikoma. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju laikas pranešamas bent jau sekundžių tikslumu. Kai sandoris sudarytas vykdančiajai įmonei kliento vardu perdavus trečiajai šaliai pavedimą, kada Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 4 straipsnyje nustatytos perdavimo sąlygos neįvykdytos, tai yra sandorio data ir laikas, o ne pavedimo perdavimo laikas.	Reguliuojama rinka (RR), daugiašalė prekybos sistema (DPS), organizuotos prekybos sistema (OPS) Patvirtintas skelbimo subjektas (PSS) Konsoliduotos informacinės juostos teikėjas (KIJT)	{DATE_TIME_FORMAT}
Priemonės identifikavimo kodas	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas.	RR, DPS PSS KIJT	{ISIN}
Kaina	Sandorio vykdymo kaina be komisinių ir sukauptų palūkanų (jei taikytina). Jei kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. Kai kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, įrašoma vertė „PNDG“. Kai kaina netaikoma, laukelis nepildomas. Šiame laukelyje pateikta informacija turi atitikti laukelyje „Kiekis“ pateiktas vertes.	RR, DPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/13} – kai kaina išreikšta pinigine verte {DECIMAL-11/10} – kai kaina išreikšta procentais arba pelningumu PNDG – kaina nežinoma
Kainos valiuta	Valiuta, kuria išreikšta kaina (taikoma, jei kaina išreikšta pinigine verte).	RR, DPS PSS KIJT	{CURRENCYCODE_3}

▼B

Laukelio identifikatorius	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pildytinas formatas, apibrėžtas 2 lentelėje
Kiekis	Finansinių priemonių vienetų skaičius. Finansinės priemonės nominalioji arba piniginė vertė. Šiame laukelyje pateikta informacija turi atitikti laukelyje „Kaina“ pateiktas vertes.	RR, DPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/17} – jei kiekis išreikštas vienetų skaičiumi. {DECIMAL-18/5} – jei kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte.
Įvykdymo vieta	Vietos, kurioje buvo įvykdytas sandoris, identifikavimas. Prekybos vietoje įvykdytiems sandoriams naudoti ISO 10383 segmento MIC kodą. Kai MIC segmentas neegzistuoja, naudoti veiklos MIC kodą. XOFF finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, kai tos finansinės priemonės sandoris įvykdytas ne prekybos vietoje, per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką arba organizuotą prekybos platformą už Sąjungos ribų, naudoti MIC kodą. Finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, kai tos finansinės priemonės sandoris įvykdytas per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką, naudoti SINT.	RR, DPS PSS KIJT	prekybos vietos: {MIC} Sistemingai sandorius savo viduje sudarantys tarpininkai SINT
Paskelbimo data ir laikas	Data ir laikas, kada prekybos vieta arba PSS paskelbė sandorį. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis atitinka reikalavimus, nustatytus Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 2 straipsnyje. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju data ir laikas nurodomi bent jau sekundžių tikslumu.	RR, DPS PSS KIJT	{DATE_TIME_FORMAT}
Paskelbimo vieta	Sandorį skelbiančios prekybos vietos arba PSS identifikavimo kodas.	KIJT	prekybos vieta: {MIC} PSS: ISO 10383 segmento MIC kodas (4 ženklų), kai yra. Kitu atveju – 4 ženklų kodas, paskelbtas EVPRI svetainėje pateiktame duomenų teikimo paslaugų teikėjų sąraše.

▼B

Laukelio identifikatorius	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pildytinas formatas, apibrėžtas 2 lentelėje
Sandorio identifikavimo kodas	Raidinis skaitinis kodas, kurį priskiria prekybos vietos (pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/580 ([1]) 12 straipsnį) ir PSS ir kuris naudojamas visose vėlesnėse nuorodose į konkretų sandorį. Sandorio identifikavimo kodas yra unikalus, nuoseklus ir nekintantis kiekvienam ISO 10383 segmento MIC kodui ir kiekvienai prekybos dienai. Kai prekybos vieta nenaudoja segmento MIC kodų, sandorio identifikavimo kodas yra unikalus, nuoseklus ir nekintantis kiekvienam veiklos MIC kodui kiekvieną prekybos dieną. Kai PSS nenaudoja MIC kodų, tai turėtų būti unikalus, nuoseklus ir nekintantis 4 ženklų kodas, naudojamas PSS identifikuoti kiekvieną prekybos dieną. Sandorio identifikavimo kodo komponentai neatskleidžia sandorio, kurio kodas saugomas, šalių tapatybės.	RR, DPS PSS KIJT	{ALPHANUM-52}

([1]) 2016 m. birželio 24 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/580, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas finansinių priemonių pavedimų atitinkamų duomenų laikymo techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 193).

4 lentelė

Žymų sąrašas skaidrumo po sandorio sudarymo tikslais

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
BENC	Kontrolinių sandorių žyma	RR, DPS PSS KIJT	Sandoriai, įvykdyti atsižvelgiant į kainą, kuri apskaičiuojama pagal keliais skirtingais momentais pagal tam tikrą lyginamąjį standartą, kaip antai vidutinė kaina, įvertinta pagal apimtį, arba vidutinė kaina, įvertinta pagal laiką.
ACTX	„Agency cross“ tipo sandorių žyma	PSS KIJT	Sandoriai, kai investicinė įmonė sudėjo drauge klientų pavedimus vykdydama to paties kiekio pirkimą ir pardavimą už tą pačią kainą kaip vieną sandorį.
NPFT	Su kainodara nesusijusių sandorių žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, kuriuose apsikeitimą finansinėmis priemonėmis lemia kiti veiksniai nei finansinių priemonių esama rinkos vertė, išvardyti 13 straipsnyje.
TNCP	Sandorių, kuriais neprisidedama prie kainos susidarymo proceso taikant Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 straipsnį, žyma	RR, DPS PSS KIJT	Sandoris, kuriuo neprisidedama prie kainos susidarymo proceso taikant Reglamento (ES) Nr. 600/2014 23 straipsnį ir kaip nustatyta 2 straipsnyje

▼B

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
SDIV	Specialaus dividendų sandorio žyma	RR, DPS PSS KIJT	Sandoriai, kurie: įvykdyti laikotarpiu po dividendų išmokėjimo, kai dividendai ar pelno paskirstymas kita forma sukaupiamas pirkėjui, o ne pardavėjui; arba įvykdyti dividendų išmokėjimo laikotarpiu, kai dividendai ar pelno paskirstymas kita forma sukaupiamas pardavėjui, o ne pirkėjui.
LRGS	Didelės apimties sandorio po sandorio sudarymo žyma	RR, DPS PSS KIJT	Palyginti su normaliu rinkos dydžiu, didelės apimties sandoriai, kurių informacijos paskelbimą leidžiama atidėti pagal 15 straipsnį.
RFPT	Referencinės kainos sandorių žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, įvykdyti sistemose, veikiančiose pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies a punktą.
NLIQ	Likvidžių finansinių priemonių suderėtų sandorių žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, įvykdyti pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies b punkto i papunktį.
OILQ	Nelikvidžių finansinių priemonių suderėtų sandorių žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, įvykdyti pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies b punkto ii papunktį.
PRIC	Suderėto sandorio, kuriam taikomos kitos sąlygos nei esama rinkos kaina, žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, įvykdyti pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 straipsnio 1 dalies b punkto iii papunktį ir kaip nustatyta 6 straipsnyje.
ALGO	Algoritminio sandorio žyma	RR, DPS KIJT	Sandoriai, įvykdyti investicinei įmonei vykdant algoritminę prekybą, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 39 punkte.
SIZE	Sandorio, viršijančio standartinį rinkos dydį, žyma	PSS KIJT	Sandoriai, įvykdyti per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką, kai gaunamo pavedimo dydis viršijo standartinį rinkos dydį, nustatytą pagal 11 straipsnį.
ILQD	Nelikvidžių priemonių sandorio žyma	PSS KIJT	Nelikvidžių finansinių priemonių, nustatytų pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/567 ([1]) 1–9 straipsnius, sandoriai, įvykdyti per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką.
RPRI	Sandorių, sudarytų už geresnę kainą, žyma	PSS KIJT	Sandoriai, įvykdyti per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 15 straipsnio 2 dalį.
CANC	Anuliavimo žyma	RR, DPS PSS KIJT	Kai atšauktas anksčiau paskelbtas sandoris.

▼B

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
AMND	Pakeitimo žyma	RR, DPS PSS KIJT	Kai pakeistas anksčiau paskelbtas sandoris.
DUPL	Pasikartojančių prekybos pranešimų žyma	PSS	Kai apie sandorį pranešta daugiau nei vienai PSS pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/571 17 straipsnio 1 dalį.

([1]) 2016 m. gegužės 18 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/567, kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 600/2014 nuostatos dėl apibrėžčių, skaidrumo, portfelio suspaudimo ir su produktais susijusių intervencinių priemonių ir pozicijų priežiūros priemonių (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 90).

▼B

II PRIEDAS

Palyginti su normaliu rinkos dydžiu, didelės apimties pavedimai, standartiniai rinkos dydžiai ir atidėtas skelbimas bei terminai

1 lentelė

Palyginti su normaliu rinkos dydžiu, didelės apimties pavedimai, susiję su akcijomis ir depozitoriumo pakvitavimais

Vidutinė dienos apyvarta (VDA), EUR	VDA < 50 000	50 000 ≤ VDA < 100 000	100 000 ≤ VDA < 500 000	500 000 ≤ VDÀ < 1 000 000	1 000 000 ≤ VDA < 5 000 000	5 000 000 ≤ VDA < 25 000 000	25 000 000 ≤ VDA < 50 000 000	50 000 000 ≤ VDA < 100 000 000	VDA < 100 000 000
Mažiausia suma, kad pavedimas būtų laikomas didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, EUR	15 000	30 000	60 000	100 000	200 000	300 000	400 000	500 000	650 000

2 lentelė

Palyginti su normaliu rinkos dydžiu, didelės apimties pavedimai, susiję su sertifikatais ir kitomis panašiomis finansinėmis priemonėmis

Vidutinė dienos apyvarta (VDA), EUR	VDA < 50 000	VDA ≥ 50 000
Mažiausia suma, kad pavedimas būtų laikomas dideliu, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, EUR	15 000	30 000

3 lentelė

Standartiniai rinkos dydžiai

Vidutinė sandorių vertė (VSV), EUR	VSV < 20 000	20 000 ≤ VSV < 40 000	40 000 ≤ VSV < 60 000	60 000 ≤ VSV < 80 000	80 000 ≤ VSV < 100 000	100 000 ≤ VSV < 120 000	120 000 ≤ VSV < 140 000	ir t. t.
Standartinis rinkos dydis	10 000	30 000	50 000	70 000	90 000	110 000	130 000	ir t. t.

▼B

4 lentelė

Informacijos apie akcijas ir depozitoriumo pakvitavimus paskelbimo atidėjimo ribos ir terminai

Vidutinė dienos apyvarta (VDA), EUR	Mažiausias sandorio dydis, kad būtų leistinas vėlavimas (EUR)	Paskelbimo po sandorio laikas
> 100 mln.	10 000 000	60 minučių
	20 000 000	120 minučių
	35 000 000	Prekybos dienos pabaiga
50–100 mln.	7 000 000	60 minučių
	15 000 000	120 minučių
	25 000 000	Prekybos dienos pabaiga
25–50 mln.	5 000 000	60 minučių
	10 000 000	120 minučių
	12 000 000	Prekybos dienos pabaiga
5–25 mln.	2 500 000	60 minučių
	4 000 000	120 minučių
	5 000 000	Prekybos dienos pabaiga
1–5 mln.	450 000	60 minučių
	750 000	120 minučių
	1 000 000	Prekybos dienos pabaiga
500 000–1 mln.	75 000	60 minučių
	150 000	120 minučių
	225 000	Prekybos dienos pabaiga
100 000–500 000	30 000	60 minučių
	80 000	120 minučių
	120 000	Prekybos dienos pabaiga
50 000–100 000	15 000	60 minučių
	30 000	120 minučių
	50 000	Prekybos dienos pabaiga
< 50 000	7 500	60 minučių
	15 000	120 minučių
	25 000	Kitos prekybos dienos pabaiga

▼B

5 lentelė

Informacijos paskelbimo atidėjimo biržiniams fondams ribinės vertės ir terminai

Mažiausias leistinas sandorio dydis, kad būtų leistinas vėlavimas (EUR)	Paskelbimo po sandorio laikas
10 000 000	60 minučių
50 000 000	Prekybos dienos pabaiga

6 lentelė

Informacijos apie sertifikatus ir kitas panašias finansines priemones paskelbimo atidėjimo ribinės vertės ir terminai

Vidutinė dienos apyvarta (VDA), EUR	Mažiausias leistinas sandorio dydis, kad būtų leistinas vėlavimas (EUR)	Paskelbimo po sandorio laikas
VDA < 50 000	15 000	120 minučių
	30 000	Prekybos dienos pabaiga
VDA ≥ 50 000	30 000	120 minučių
	60 000	Prekybos dienos pabaiga

▼B

III PRIEDAS

Baziniai duomenys, pateiktini su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

1 lentelė

Simbolių lentelė

Simbolis	Duomenų rūšis	Apibrėžtis
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{ISIN}	12 raidinių skaitinių ženklų	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{MIC}	4 raidinių skaitinių ženklų	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.

2 lentelė

Informacija apie bazinius duomenis, pateiktinus su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

#	Laukelis	Išsami informacija, kurią reikia pateikti	Informacijos teikimo formatas ir standartai
1	Priemonės identifikavimo kodas	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas.	{ISIN}
2	Nesutrumpintas priemonės pavadinimas	Nesutrumpintas finansinės priemonės pavadinimas.	{ALPHANUM-350}
3	Prekybos vieta	Prekybos vietos arba sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko segmento MIC kodas, kai yra; priešingu atveju – veiklos MIC kodas.	{MIC}
4	FPRR identifikatorius	Nuosavo kapitalo finansinių priemonių identifikavimas: **akcijos**, kaip nurodyta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 44 dalies a punkte; **depozitoriumo pakvitavimai**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 45 dalyje; **biržiniai fondai**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/EEB 4 straipsnio 46 dalyje, **sertifikatai**, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 27 punkte. **kita į nuosavo kapitalo finansines priemones panaši priemonė** yra perleidžiamasis vertybinis popierius, kuris yra nuosavo kapitalo finansinė priemonė, panaši į akciją, biržinį fondą, depozitoriumo pakvitavimą arba sertifikatą, tačiau nėra akcija, biržinis fondas, depozitoriumo pakvitavimas ar sertifikatas.	Nuosavo kapitalo finansinės priemonės: SHRS = akcijos ETFS = biržiniai fondai DPRS = depozitoriumo pakvitavimai CRFT = sertifikatai OTHR = kitos į nuosavo kapitalo finansines priemones panašios priemonės