KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/589

2016 m. liepos 19 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma techniniais reguliavimo standartais, kuriais patikslinami investicinėms įmonėms, vykdančioms algoritminę prekybą, taikomi organizaciniai reikalavimai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamos Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES ([1]), ypač į jos 17 straipsnio 7 dalies a ir d punktus,

kadangi:

(1) investicinės įmonės, vykdančios algoritminę prekybą, teikiančios tiesioginę elektroninę prieigą (TEP) ar veikiančios kaip bendroji tarpuskaitos narė, naudojamos sistemos ir rizikos kontrolės priemonės turėtų būti veiksmingos, atsparios ir pakankamo pajėgumo atsižvelgiant į tos investicinės įmonės verslo modelio pobūdį, mastą ir sudėtingumą;

(2) todėl investicinė įmonė turėtų valdyti visą riziką, kuri gali daryti poveikį pagrindiniams algoritminės prekybos sistemų elementams, įskaitant riziką, susijusią su techninė ir programine įranga bei susijusiomis ryšių linijomis, kurias ta įmonė naudoja vykdydama savo prekybos veiklą. Siekiant užtikrinti vienodas algoritminės prekybos sąlygas nepriklausomai nuo prekybos formos, šis reglamentas turėtų būti taikomas visų rūšių vykdymo sistemoms ar pavedimų valdymo sistemoms, valdomoms investicinių įmonių;

(3) investicinių įmonių bendra valdymo ir sprendimų priėmimo sistema turėtų apimti aiškią ir įformintą valdymo tvarką, įskaitant aiškias atskaitomybės linijas, veiksmingas informacijos perdavimo procedūras ir užduočių bei atsakomybės sričių atskyrimą. Ta tvarka reikėtų užtikrinti mažesnį priklausymą nuo vieno asmens arba skyriaus;

(4) reikėtų atlikti derėjimo testavimą siekiant patikrinti, ar investicinės įmonės prekybos sistemos tinkamai susisiekia ir sąveikauja su prekybos vietos arba tiesioginės prieigos prie rinkos (TPR) teikėjo prekybos sistemomis ir ar rinkos duomenys apdorojami teisingai;

(5) investicinių sprendimų algoritmai automatiškai priima sprendimus dėl prekybos, kuriais nustatoma, kurią finansinę priemonę pirkti ar parduoti. Pavedimų vykdymo algoritmai optimizuoja pavedimų vykdymo procesus, po investicinio sprendimo priėmimo automatiškai sukurdami ir pateikdami pavedimus ar kotiruotes vienai ar kelioms prekybos vietoms. Prekybos algoritmai, kurie yra investicinių sprendimų algoritmai, dėl jų galimo poveikio bendram sąžiningam ir tvarkingam rinkos veikimui turėtų būti skiriami nuo pavedimų vykdymo algoritmų;

(6) prekybos algoritmų testavimo reikalavimai turėtų būti grindžiami galimu šių algoritmų poveikiu bendram sąžiningam ir tvarkingam rinkos veikimui. Šiuo atžvilgiu šie testavimo reikalavimai turėtų būti netaikomi tik grynai investicinių sprendimų algoritmams, kurie sukuria pavedimus, vykdytinus tik neautomatizuotai ir dalyvaujant žmogui;

(7) įvesdama naujus prekybos algoritmus, investicinė įmonė turėtų užtikrinti, kad būtų laikomasi kontroliuojamo prekybos algoritmų diegimo tvarkos, nepriklausomai nuo to, ar tie prekybos algoritmai yra nauji, ar jie anksčiau buvo sėkmingai įdiegti kitoje prekybos vietoje ir ar jų architektūra buvo iš esmės pakeista. Kontroliuojamo

([1]) OL L 173, 2014 6 12, p. 349.

prekybos algoritmų diegimo tvarka turėtų būti užtikrinamas numatytas prekybos algoritmų veikimas realioje aplinkoje. Todėl investicinė įmonė turėtų nustatyti apdairias ribas, taikytinas finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama, skaičiui, pavedimų kainai, vertei ir skaičiui, strateginėms pozicijoms ir susijusių rinkų skaičiui, ir aktyviau stebėti algoritmo veiklą;

(8) investicinės įmonės atitiktis konkretiems organizaciniams reikalavimams turėtų būti nustatoma pagal įsivertinimą, apimantį atitikties šio reglamento I priede pateiktiems kriterijams vertinimą. Be to, tas įsivertinimas turėtų apimti ir visas kitas aplinkybes, kurios gali daryti poveikį tos investicinės įmonės organizacinei struktūrai. Tas įsivertinimas turėtų būti atliekamas reguliariai ir padėti investicinei įmonei visapusiškai suprasti savo naudojamas prekybos sistemas ir prekybos algoritmus bei dėl algoritminės prekybos kylančią riziką, nepriklausomai nuo to, ar tos sistemos ir algoritmai buvo sukurti pačios investicinės įmonės, pirkti iš trečiosios šalies, ar suprojektuoti ir sukurti glaudžiai bendradarbiaujant su klientu ar trečiąja šalimi;

(9) investicinė įmonė turėtų turėti galimybę atšaukti visus ar kai kuriuos savo pavedimus, kai to prireikia (visiško atjungimo funkcija). Kad toks atšaukimas būtų įvykdomas, investicinė įmonė visada privalo žinoti, kurie prekybos algoritmai, prekiautojai ar klientai yra atsakingi už pavedimą;

(10) algoritminę prekybą vykdanti investicinė įmonė turėtų stebėti, kad jos prekybos sistemų nebūtų galima naudoti jokiu kitu tikslu, prieštaraujančiu Europos Parlamento ir Tarybos reglamentui (ES) Nr. 596/2014 ([1]) arba prekybos vietos, prie kurios ji yra prisijungusi, taisyklėms. Apie įtartinus sandorius arba pavedimus pagal tą reglamentą turėtų būti pranešta kompetentingoms institucijoms;

(11) skirtingų rūšių rizika turėtų būti valdoma taikant skirtingų rūšių kontrolę. Kontrolė prieš sudarant sandorį turėtų būti vykdoma prieš pateikiant pavedimą prekybos vietai. Be to, investicinė įmonė turėtų stebėti savo prekybos veiklą ir įdiegti įspėjimo realiuoju laiku sistemą, aptinkančią netvarkingos prekybos požymius arba jos ribų, nustatytų prieš sudarant sandorį, nesilaikymą. Turėtų būti nustatyta kontrolė sudarius sandorį, kurios metu atliekant sutikrinimą po sandorio sudarymo būtų stebima investicinės įmonės rinkos ir kredito rizika. Be to, taikant specialias priežiūros sistemas, generuojančias įspėjimus vėliausiai kitą dieną ir sureguliuotas taip, kad būtų pateikiama kuo mažiau klaidingai teigiamų ir klaidingai neigiamų įspėjimų, reikėtų vykdyti potencialaus piktnaudžiavimo rinka atvejų ir prekybos vietos taisyklių pažeidimų prevenciją;

(12) įspėjimai turėtų būti generuojami kuo skubiau, kiek techniškai įmanoma, po pastebėjimo realiuoju laiku. Visų veiksmų po to pastebėjimo turėtų būti imtasi kiek galima skubiau atsižvelgiant į pagrįstą susijusių asmenų ir sistemų veiksmingumą ir išlaidas;

(13) investicinė įmonė, teikianti tiesioginę elektroninę prieigą (TEP teikėjas), turėtų likti atsakinga už prekybą, kurią naudodamiesi jos prekybos kodu vykdė jos TEP klientai. Todėl TEP teikėjas turėtų nustatyti politiką ir procedūras, kuriomis būtų užtikrinama, kad jo TEP klientai laikytųsi tam teikėjui taikytinų reikalavimų. Ta atsakomybė turėtų tapti pagrindiniu akstinu, kad būtų nustatytos kontrolės prieš sudarant sandorį ir jį sudarius priemonės ir įvertintas būsimų TEP klientų tinkamumas. Todėl TEP teikėjas turėtų turėti pakankamai informacijos apie savo TEP klientų ketinimus, pajėgumą, finansinius išteklius ir patikimumą, įskaitant viešai skelbiamą informaciją apie būsimų TEP klientų drausmės istoriją kompetentingų institucijų ir prekybos vietų atžvilgiu;

(14) TEP teikėjas turėtų laikytis šio reglamento nuostatų net ir tais atvejais, kai nevykdo algoritminės prekybos, nes jo klientai gali naudotis TEP algoritminei prekybai vykdyti;

(15) būsimų TEP klientų išsamus patikrinimas turėtų būti pritaikytas pagal riziką, kurią kelia jų numatomos prekybos veiklos pobūdis, mastas ir sudėtingumas, ir pagal teikiamą TEP. Visų pirma reikėtų įvertinti numatomą prekybos lygį ir pavedimų apimtį, taip pat atitinkamoms prekybos vietoms siūlomo ryšio rūšį;

(16) reikėtų nustatyti didelio dažnio prekybos metodą naudojančių investicinių įmonių, teikiant kompetentingoms institucijoms savo pateiktų pavedimų įrašus, naudotinų formų turinį ir formatą, taip pat tų įrašų saugojimo trukmę;

([1]) 2014 m. balandžio 16 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 596/2014 dėl piktnaudžiavimo rinka (Piktnaudžiavimo rinka reglamentas) ir kuriuo panaikinama Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2003/6/EB ir Komisijos direktyvos 2003/124/EB, 2003/125/EB ir 2004/72/EB (OL L 173, 2014 6 12, p. 1).

(17) siekiant užtikrinti derėjimą su nustatyta bendrąja investicinės įmonės pareiga saugoti pavedimų įrašus, įrašų saugojimo laikotarpiai, kurių privalo laikytis didelio dažnio algoritminės prekybos metodą naudojanti investicinė įmonė, turėtų būti suderinti su laikotarpiais, nurodytais Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 600/2014 ([1]) 25 straipsnio 1 dalyje;

(18) nuoseklumo sumetimais ir siekiant užtikrinti sklandų finansų rinkų veikimą, būtina, kad šiame reglamente nustatytos nuostatos ir susijusios nacionalinės nuostatos, kuriomis į nacionalinę teisę perkeliama Direktyva 2014/65/ES, būtų pradėtos taikyti tą pačią dieną;

(19) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktais techninių reguliavimo standartų projektais;

(20) EVPRI dėl techninių reguliavimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([2]) 37 straipsniu, pateikti savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

I SKYRIUS

BENDRIEJI ORGANIZACINIAI REIKALAVIMAI

1 straipsnis

Bendrieji organizaciniai reikalavimai

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

Laikydamasi bendros valdymo ir sprendimų priėmimo sistemos, investicinė įmonė įdiegia ir stebi savo prekybos sistemas ir prekybos algoritmus pagal aiškią ir įformintą valdymo tvarką, kuria atsižvelgiama į jos veiklos pobūdį, mastą bei sudėtingumą ir nustatoma:

a) aiškios atskaitomybės linijos, įskaitant procedūras, pagal kurias tvirtinamas prekybos algoritmų kūrimas, diegimas ir paskesnis atnaujinimas ir sprendžiamos stebint prekybos algoritmus aptiktos problemos;

b) veiksmingos informacijos perdavimo investicinėje įmonėje procedūros, pagal kurias nurodymus galima gauti ir įgyvendinti produktyviai ir laiku;

c) sandorius sudarančių darbuotojų ir papildomas funkcijas, įskaitant rizikos kontrolės ir atitikties užtikrinimo funkcijas, atliekančių darbuotojų užduočių ir atsakomybės sričių atskyrimas, kuriuo užtikrinama, kad neteisėtos prekybos veiklos nebūtų įmanoma nuslėpti.

2 straipsnis

Atitikties užtikrinimo funkcijos svarba

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė užtikrina, kad atitikties užtikrinimo funkciją atliekantys jos darbuotojai bent bendrais bruožais suprastų, kaip veikia investicinės įmonės algoritminės prekybos sistemos ir prekybos algoritmai. Atitikties užtikrinimo funkciją atliekantys darbuotojai nuolat palaiko ryšį su įmonės darbuotojais, gerai išmanančiais įmonės algoritminės prekybos sistemų ir algoritmų techninę pusę.

([1]) 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 173, 2014 6 12, p. 84).

([2]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

2. Be to, investicinė įmonė užtikrina, kad atitikties užtikrinimo funkciją atliekantys darbuotojai visada palaikytų ryšį su investicinės įmonės darbuotoju ar darbuotojais, turinčiais prieigą prie 12 straipsnyje nurodytos funkcijos (visiško atjungimo funkcijos), arba turėtų tiesioginę prieigą prie tos visiško atjungimo funkcijos ir asmenų, atsakingų už kiekvieną prekybos sistemą ar algoritmą.

3. Kai atitikties užtikrinimo funkcija ar jos elementai yra patikėti trečiajai šaliai, investicinė įmonė trečiajai šaliai suteikia tokią pačią prieigą prie informacijos, kokią suteiktų savo pačios atitikties užtikrinimo funkciją atliekantiems darbuotojams. Investicinė įmonė užtikrina, kad atliekant tokią išorinę atitikties užtikrinimo funkciją:

a) būtų garantuotas duomenų privatumas;

b) vidaus ir išorės auditoriai arba kompetentinga institucija galėtų atlikti atitikties užtikrinimo funkcijos auditą.

3 straipsnis

Personalas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Savo algoritminės prekybos sistemoms ir prekybos algoritmams valdyti investicinė įmonė įdarbina pakankamai reikiamos kvalifikacijos darbuotojų, turinčių pakankamai techninių žinių apie:

a) susijusias prekybos sistemas ir algoritmus;

b) tokių sistemų ir algoritmų stebėjimą ir testavimą;

c) prekybos strategijas, kurias investicinė įmonė vykdo naudodama savo algoritminės prekybos sistemas ir prekybos algoritmus;

d) investicinės įmonės teisines prievoles.

2. Investicinė įmonė patikslina 1 dalyje nurodytą reikiamą kvalifikaciją. 1 dalyje nurodyti darbuotojai šią reikiamą kvalifikaciją turi įdarbinimo metu arba įgyja per mokymus po įdarbinimo. Investicinė įmonė užtikrina, kad ši darbuotojų kvalifikacija būtų atnaujinama per nuolatinius mokymus ir reguliariai ją vertina.

3. 2 dalyje nurodyti darbuotojų mokymai yra pritaikomi prie darbuotojų patirties ir atsakomybės sričių atsižvelgiant į investicinės įmonės veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą. Visų pirma darbuotojams, dalyvaujantiems pavedimų pateikimo procese, surengiami mokymai pavedimų pateikimo sistemų ir piktnaudžiavimo rinka temomis.

4. Investicinė įmonė užtikrina, kad algoritminės prekybos rizikos valdymo ir atitikties užtikrinimo funkcijas atliekantys darbuotojai turėtų:

a) pakankamai žinių apie algoritminę prekybą ir strategijas;

b) pakankamą kvalifikaciją reaguoti į automatiniuose įspėjimuose pateikiamą informaciją;

c) pakankamai įgaliojimų sustabdyti už algoritminę prekybą atsakingų darbuotojų veiksmus, kai tokia prekyba lemia tvarką pažeidžiančias prekybos sąlygas ar kelia įtarimų dėl piktnaudžiavimo rinka.

4 straipsnis

IT paslaugų patikėjimas trečiosioms šalims ir pirkimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė, trečiosioms šalims patikinti arba perkanti programinę ar techninę įrangą, naudojamą algoritminės prekybos veiklai, išlieka visiškai atsakinga už savo pareigas pagal šį reglamentą.

2. Investicinė įmonė turi pakankamai žinių ir reikiamus dokumentus, kad galėtų užtikrinti, kad 1 dalies reikalavimų, susijusių su algoritminei prekybai naudojama trečiosioms šalims patikėta arba perkama technine ar programine įranga, būtų veiksmingai laikomasi.

II SKYRIUS

PREKYBOS SISTEMŲ ATSPARUMAS

I SKIRSNIS

Prekybos algoritmų sistemų ir strategijų testavimas ir diegimas

5 straipsnis

Bendroji metodika

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Prieš diegdama arba iš esmės atnaujindama algoritminės prekybos sistemą, prekybos algoritmą ar algoritminės prekybos strategiją, investicinė įmonė nustato aiškiai apibrėžtas tokių sistemų, algoritmų ar strategijų kūrimo ir testavimo metodikas.

2. Algoritminės prekybos sistemai, prekybos algoritmui ar algoritminės prekybos strategijai diegti arba iš esmės atnaujinti reikalingas investicinės įmonės vyresniosios vadovybės paskirto asmens leidimas.

3. Pagal 1 dalyje nurodytas metodikas nustatomas algoritminės prekybos sistemos, prekybos algoritmo ar algoritminės prekybos strategijos parengimas, veikimas, įrašų saugojimas ir tvirtinimas. Be to, jomis nustatomas atsakomybės sričių pasiskirstymas, pakankamų išteklių paskyrimas ir kreipimosi dėl nurodymų investicinėje įmonėje procedūros.

4. 1 dalyje nurodytomis metodikomis užtikrinama, kad algoritminės prekybos sistema, prekybos algoritmas ar algoritminės prekybos strategija:

a) neveiktų ne pagal paskirtį;

b) atitiktų investicinės įmonės pareigas pagal šį reglamentą;

c) atitiktų prekybos vietų, prie kurių jungiasi investicinė įmonė, taisykles ir sistemas;

d) neskatintų tvarką pažeidžiančių prekybos sąlygų, veiksmingai tęstų darbą nepalankiomis rinkos sąlygomis ir prireikus tomis sąlygomis leistų išjungti algoritminės prekybos sistemą arba prekybos algoritmą.

5. Investicinė įmonė pritaiko savo testavimo metodiką prie prekybos vietų ir rinkų, kuriose bus diegiamas prekybos algoritmas. Investicinė įmonė atlieka papildomą testavimą, jei algoritminės prekybos sistema arba prieiga prie prekybos vietos, kurioje turi būti naudojama algoritminės prekybos sistema, prekybos algoritmas ar algoritminės prekybos strategija, iš esmės pakeičiama.

6. 2–5 dalys taikomos tik prekybos algoritmams, pagal kuriuos vykdomi pavedimai.

7. Investicinė įmonė saugo visų algoritminės prekybos programinės įrangos esminių pakeitimų įrašus, kuriais remiantis galima sužinoti:

a) kada padarytas pakeitimas;

b) kuris asmuo pakeitimą padarė;

c) kuris asmuo pakeitimą patvirtino;

d) pakeitimo pobūdį.

6 straipsnis

Derėjimo testavimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė testuoja savo algoritminės prekybos sistemų ir prekybos algoritmų derėjimą su:

a) prekybos vietos sistema bet kuriuo iš šių atvejų:

   i) jungiantis prie tos prekybos vietos nario teisėmis;

   ii) pirmą kartą jungiantis prie tos prekybos vietos pagal suteiktosios prieigos susitarimą;

iii) po esminio tos prekybos vietos sistemų pakeitimo;

iv) prieš diegdama arba iš esmės atnaujindama savo algoritminės prekybos sistemą, prekybos algoritmą ar algoritminės prekybos strategiją;

b) tiesioginės prieigos prie rinkos teikėjo sistema bet kuriuo iš šių atvejų:

i) pirmą kartą jungiantis prie tos prekybos vietos pagal tiesioginės prieigos prie rinkos susitarimą;

ii) po esminio pakeitimo, turinčio poveikį to teikėjo tiesioginės prieigos prie rinkos funkcionalumui;

iii) prieš diegdama arba iš esmės atnaujindama savo algoritminės prekybos sistemą, prekybos algoritmą ar algoritminės prekybos strategiją.

2. Derėjimo testavimu patikrinama, ar algoritminės prekybos sistemos ar prekybos algoritmo pagrindiniai elementai veikia teisingai ir pagal prekybos vietos arba tiesioginės prieigos prie rinkos teikėjo reikalavimus. Todėl testavimu patikrinama, ar algoritminės prekybos sistema ar prekybos algoritmas:

a) numatytu būdu sąveikauja su prekybos vietos derinimo logika;

b) tinkamai apdoroja duomenų srautus, atsisiunčiamus iš prekybos vietos.

7 straipsnis

Testavimo aplinka

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė užtikrina, kad atitiktis 5 straipsnio 4 dalies a, b ir d punktuose išdėstytiems kriterijams būtų tikrinama aplinkoje, atskirtoje nuo jos realios aplinkos ir naudojamoje konkrečiai algoritminės prekybos sistemoms ir prekybos algoritmams testuoti ir kurti.

Taikant pirmą pastraipą, reali aplinka yra aplinka, kurioje efektyviai veikia algoritminės prekybos sistemos ir kurią sudaro prekiautojų naudojama programinė ir techninė įranga, pavedimų nukreipimas prekybos vietoms, rinkos duomenys, priklausomos duomenų bazės, rizikos kontrolės sistemos, duomenų išgava, analizės sistemos ir apdorojimo sudarius sandorį sistemos.

2. Investicinė įmonė 1 dalyje nurodytus testavimo reikalavimus gali įvykdyti naudodama savo testavimo aplinką arba prekybos vietos, TEP teikėjo arba pardavėjo suteiktą testavimo aplinką.

3. Investicinė įmonė išlieka visiškai atsakinga už savo algoritminės prekybos sistemų, prekybos algoritmų ar algoritminės prekybos strategijų testavimą ir reikalingų jų pakeitimų atlikimą.

8 straipsnis

Kontroliuojamas algoritmų diegimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

Prieš diegdama prekybos algoritmą investicinė įmonė nustato iš anksto apibrėžtas ribas:

a) finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama, skaičiui;

b) pavedimų kainai, vertei ir skaičiui;

c) strateginėms pozicijoms;

d) prekybos vietų, kurioms siunčiami pavedimai, skaičiui.

2 SKIRSNIS

Valdymas po diegimo

9 straipsnis

Metinis įsivertinimas ir patikrinimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė kasmet vykdo įsivertinimo ir patikrinimo procesą ir pagal jo rezultatus paskelbia patikrinimo ataskaitą. Vykdydama tą procesą investicinė įmonė peržiūri, įvertina ir patikrina šias sritis:

a) savo algoritminės prekybos sistemas, prekybos algoritmus ir algoritminės prekybos strategijas;

b) savo valdymo, atskaitomybės ir tvirtinimo sistemą;

c) savo veiklos tęstinumo priemones;

d) savo veiklos pobūdžio, masto ir sudėtingumo bendrą atitiktį Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsniui.

Įsivertinimas taip pat apima bent atitikties šio reglamento I priede nurodytiems kriterijams analizę.

2. Rizikos valdymo funkciją atliekantys investicinės įmonės darbuotojai, nurodyti Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/565 ([1]) 23 straipsnio 2 dalyje, pasitelkdami reikiamų techninių žinių turintį personalą, parengia patikrinimo ataskaitą. Rizikos valdymo funkciją atliekantys darbuotojai informuoja atitikties užtikrinimo funkciją atliekančius darbuotojus apie visus trūkumus, nustatytus patikrinimo ataskaitoje.

3. Patikrinimo ataskaitos auditą atlieka įmonės vidaus audito funkciją atliekantys darbuotojai, kai tokia funkcija yra, ir tvirtina investicinės įmonės vyresnioji vadovybė.

4. Investicinė įmonė ištaiso visus trūkumus, nustatytus patikrinimo ataskaitoje.

5. Kai investicinėje įmonėje nėra rizikos valdymo funkcijos, nurodytos Deleguotojo reglamento (ES) 2017/565 23 straipsnio 2 dalyje, šiame reglamente nustatyti rizikos valdymo funkcijos reikalavimai taikomi kitai funkcijai, kurią investicinė įmonė yra nustačiusi pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/565 23 straipsnio 2 dalį.

10 straipsnis

Testavimas nepalankiausiomis sąlygomis

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

Atlikdama 9 straipsnyje nurodytą metinį įsivertinimą, investicinė įmonė testuoja savo algoritminės prekybos sistemas, procedūras ir kontrolę, nurodytas 12–18 straipsniuose, siekdama patikrinti, ar jos gali atlaikyti padidėjusius pavedimų srautus arba nepalankias rinkos sąlygas. Investicinė įmonė parengia tokį testavimą atsižvelgdama į savo prekybos veiklos ir prekybos sistemų pobūdį. Investicinė įmonė užtikrina, kad testavimas būtų atliekamas taip, kad nedarytų poveikio realiai aplinkai. Tas testavimas apima:

a) testavimą labai didelio pranešimų kiekio sąlygomis, kai naudojamas padvigubintas didžiausias kiekis pranešimų, per praėjusius šešis mėnesius gautų ir išsiųstų investicinės įmonės;

b) testavimą labai didelės prekybos apimties sąlygomis, kai naudojama padvigubinta didžiausia prekybos apimtis, kurią per praėjusius šešis mėnesius pasiekė investicinė įmonė.

([1]) 2016 m. balandžio 25 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/565, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma nuostatomis dėl investicinių įmonių organizacinių reikalavimų bei veiklos sąlygų ir toje direktyvoje apibrėžtų terminų (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 1).

11 straipsnis

Esminių pakeitimų valdymas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė užtikrina, kad prieš atliekant bet kokį siūlomą esminį realios aplinkos, susijusios su algoritmine prekyba, pakeitimą, tą pakeitimą peržiūrėtų investicinės įmonės vyresniosios vadovybės paskirtas asmuo. Peržiūros išsamumas yra proporcingas siūlomo pakeitimo mastui.

2. Investicinė įmonė nustato procedūras, pagal kurias užtikrinama, kad apie bet kokius jos sistemos funkcijų pakeitimus būtų pranešama už prekybos algoritmą atsakingiems prekiautojams bei atitikties užtikrinimo ir rizikos valdymo funkcijas atliekantiems darbuotojams.

3 SKIRSNIS

Atsparumo užtikrinimo priemonės

12 straipsnis

Visiško atjungimo funkcija

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė turi galimybę kritinėmis aplinkybėmis nedelsdama anuliuoti kai kuriuos arba visus neįvykdytus savo pavedimus, pateiktus kurioms nors arba visoms prekybos vietoms, prie kurių investicinė įmonė yra prisijungusi (visiško atjungimo funkcija).

2. Taikant 1 dalį, neįvykdyti pavedimai apima pavedimus, kuriuos sukūrė pavieniai prekiautojai, sandorius sudarantys darbuotojai ar atitinkamais atvejais klientai.

3. Taikant 1 ir 2 dalis, investicinė įmonė gali nustatyti, kuris prekybos algoritmas ir kuris prekiautojas, sandorius sudarantis darbuotojas ar atitinkamais atvejais klientas yra atsakingas už kiekvieną prekybos vietai išsiųstą pavedimą.

13 straipsnis

Automatinė priežiūros sistema piktnaudžiavimo rinka atvejams nustatyti

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė stebi visą prekybos veiklą, vykdomą per jos prekybos sistemas, įskaitant savo klientų prekybos veiklą, siekdama nustatyti galimo piktnaudžiavimo rinka požymius, nurodytus Reglamento (ES) Nr. 596/2014 12 straipsnyje.

2. Taikydama 1 dalį, investicinė įmonė nustato ir prižiūri automatinę priežiūros sistemą, kuri veiksmingai stebi pavedimus bei sandorius, generuoja įspėjimus ir ataskaitas, taip pat atitinkamais atvejais pasitelkia vizualizacijos įrankius.

3. Automatinė priežiūros sistema stebi visą prekybos veiklos, kuria užsiima investicinė įmonė, spektrą ir visus jos pateiktus pavedimus. Automatinė priežiūros sistema parengiama atsižvelgiant į investicinės įmonės prekybos veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą, pavyzdžiui, į finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama, rūšį ir kiekį, įmonės pavedimų srauto dydį bei sudėtingumą ir rinkas, kuriose vykdoma veikla.

4. Investicinė įmonė atlieka visų įtartinos prekybos veiklos požymių, kuriuos jos automatinė priežiūros sistema tyrimo etapu nustatė lygindama su tos įmonės kita atitinkama prekybos veikla, kryžminę patikrą.

5. Investicinės įmonės automatinę priežiūros sistemą turi būti galima pritaikyti prie investicinės įmonės reguliavimo pareigų ir prekybos veiklos pakeitimų, įskaitant tos įmonės ir jos klientų prekybos strategijos pakeitimus.

6. Investicinė įmonė peržiūri savo automatinę priežiūros sistemą bent kartą per metus, kad įvertintų, ar ta sistema ir jos naudojami parametrai ir filtrai dar vis atitinka investicinės įmonės reguliavimo pareigas ir prekybos veiklą, kartu patikrindama priežiūros sistemos gebėjimą teikti kuo mažiau klaidingai teigiamų ir klaidingai neigiamų priežiūros įspėjimų.

7. Investicinės įmonės automatinė priežiūros sistema, naudodama pakankamai tikslų laiko žymėjimą, turi galimybę nuskaityti, pakartotinai peržiūrėti ir analizuoti pavedimų ir sandorių duomenis *ex post* ir yra pakankamai pajėgi atitinkamais atvejais veikti automatizuotoje mažos delsos prekybos aplinkoje. Be to, ji turi galimybę generuoti naudingus įspėjimus kitos prekybos dienos pradžioje arba – rankinių procesų atveju – kitos prekybos dienos pabaigoje. Investicinės įmonės priežiūros sistema turi tinkamus dokumentus ir nustatytas procedūras, pagal kuriuos turi būti veiksmingai reaguojama į jos sugeneruotus įspėjimus.

8. Už investicinės įmonės prekybos veiklos stebėjimą pagal 1–7 dalis atsakingi darbuotojai apie bet kokią prekybos veiklą, kuri gali prieštarauti investicinės įmonės politikai ir procedūroms arba jos reguliavimo pareigoms, praneša atitikties užtikrinimo funkciją atliekantiems darbuotojams. Atitikties užtikrinimo funkciją atliekantys darbuotojai tą informaciją įvertina ir imasi tinkamų veiksmų. Tokie veiksmai apima pranešimą prekybos vietai arba pranešimo apie įtartiną sandorį ar pavedimą pateikimą pagal Reglamento (ES) Nr. 596/2014 16 straipsnį.

9. Investicinė įmonė užtikrina savo prekybos ir apskaitos informacijos įrašų tikslumą, išsamumą ir nuoseklumą kuo greičiau sutikrindama savo elektroninės prekybos žurnalus su prekybos vietų, maklerių, tarpuskaitos narių, pagrindinių sandorio šalių, duomenų teikėjų ar kitų susijusių verslo partnerių įrašais, jei tai reikalinga ir tinkama atsižvelgiant į veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą.

14 straipsnis

Veiklos tęstinumo priemonės

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė savo algoritminės prekybos sistemoms yra nustačiusi veiklos tęstinumo priemones, atitinkančias jos veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą. Tos priemonės yra dokumentuojamos patvariojoje laikmenoje.

2. Investicinės įmonės veiklos tęstinumo priemonėmis veiksmingai reaguojama į trikdžius sukeliančius incidentus ir atitinkamais atvejais užtikrinamas algoritminės prekybos atnaujinimas laiku. Tos priemonės pritaikomos prie kiekvienos prekybos vietos, prie kurios jungiamasi, prekybos sistemų ir apima šiuos elementus:

a) veiklos tęstinumo priemonės kūrimo ir diegimo valdymo sistemą;

b) įvairiausius įmanomus neigiamus scenarijus, susijusius su algoritminės prekybos sistemų veikimu, įskaitant negalėjimą naudotis sistemomis, darbuotojais, darbo patalpomis, išorės tiekėjais ar duomenų centrais arba labai svarbių duomenų ir dokumentų praradimą ar pasikeitimą;

c) prekybos sistemos perkėlimo į atsarginę stotį ir jos valdymo iš tos stoties procedūras, kai atsižvelgiant į investicinės įmonės algoritminės prekybos veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą turėti tokią stotį tikslinga;

d) darbuotojų mokymą, susijusį su veiklos tęstinumo priemonių taikymu;

e) naudojimo politiką 12 straipsnyje nurodytos funkcijos atžvilgiu;

f) atitinkamo prekybos algoritmo ar prekybos sistemos atjungimo, kai prireikia, priemones;

g) alternatyvias priemones, kuriomis investicinė įmonė galėtų tvarkyti neįvykdytus pavedimus ir pozicijas.

3. Investicinė įmonė užtikrina, kad pagal jos veiklos tęstinumo priemones jos prekybos algoritmą arba prekybos sistemą būtų galima išjungti nesudarant tvarką pažeidžiančių prekybos sąlygų.

4. Investicinė įmonė kasmet peržiūri ir testuoja savo veiklos tęstinumo priemones, taip pat atsižvelgdama į tos peržiūros išvadas tas priemones keičia.

15 straipsnis

Kontrolė prieš sudarant sandorį, atliekama įvedant pavedimą

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė prieš sudarant sandorį atlieka įvedamų pavedimų, susijusių su visomis finansinėmis priemonėmis, toliau nurodytų parametrų kontrolę:

a) kainos apsaugos strategijos, pagal kurią automatiškai blokuojami arba anuliuojami pavedimai, neatitinkantys nustatytų kainos parametrų (kurie skirtingoms finansinėms priemonėms yra nevienodi) tiek atskirų pavedimų atžvilgiu, tiek konkretaus laikotarpio atžvilgiu;

b) didžiausių pavedimų verčių, kuriomis neleidžiama į pavedimų knygą įtraukti pavedimų, kurių vertė neįprastai didelė;

c) didžiausios pavedimų apimties, kuria neleidžiama į pavedimų knygą įtraukti pavedimų, kurių dydis neįprastai didelis;

d) didžiausio pranešimų kiekio ribų, kuriomis neleidžiama į pavedimų knygas išsiųsti per didelio kiekio pranešimų, susijusių su pavedimo pateikimu, pakeitimu ar anuliavimu.

2. Investicinė įmonė nedelsdama atsižvelgia į visus prekybos vietai išsiųstus pavedimus atlikdama 1 dalyje nurodytų ribų, nustatomų prieš sudarant sandorį, skaičiavimus.

3. Investicinė įmonė įdiegia pakartotinio automatizuoto vykdymo stabdiklius, kuriais kontroliuojamas algoritminės prekybos strategijos taikymo kartų skaičius. Kai iš anksto nustatytas pakartotinio vykdymo kartų skaičius pasiekiamas, prekybos sistema automatiškai išjungiama tol, kol ją vėl aktyvuoja paskirtas darbuotojas.

4. Investicinė įmonė pagal savo reguliuojamąjį kapitalą, tarpuskaitos susitarimus, prekybos strategiją, priimtiną riziką, patirtį ir tam tikrus kintamuosius, kaip antai laikotarpis, kurį investicinė įmonė vykdo algoritminę prekybą, ir jos priklausomumas nuo pardavėjų, kurie yra trečiosios šalys, nustato taikytinas rinkos ir kredito rizikos ribas. Investicinė įmonė tas rinkos ir kredito rizikos ribas koreguoja atsižvelgdama į dėl skirtingų kainos ir likvidumo lygių kintantį pavedimų poveikį atitinkamai rinkai.

5. Investicinė įmonė automatiškai blokuoja ar anuliuoja prekiautojo pavedimus, jei sužino, kad tas prekiautojas neturi leidimo prekiauti konkrečia finansine priemone. Investicinė įmonė automatiškai blokuoja ar anuliuoja pavedimus, kai dėl tų pavedimų kyla rizika nesilaikyti pačios investicinės įmonės rizikos ribų. Atitinkamais atvejais atliekama atskirų klientų, finansinių priemonių, prekiautojų, sandorius sudarančių darbuotojų ar visos investicinės įmonės pozicijų kontrolė.

6. Investicinė įmonė nustato procedūras ir priemones, pagal kurias tvarkomi pavedimai, kurie yra užblokuoti atlikus investicinės įmonės kontrolę prieš sudarant sandorį, tačiau kuriuos investicinė įmonė vis tiek pageidauja pateikti. Tokios procedūros ir priemonės išskirtinėmis aplinkybėmis laikinai taikomos konkrečiam sandoriui. Jas patikrina rizikos valdymo funkcijas atliekantys darbuotojai ir leidžia taikyti paskirtas investicinės įmonės darbuotojas.

16 straipsnis

Stebėjimas realiuoju laiku

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Tomis valandomis, kuriomis investicinė įmonė siunčia pavedimus prekybos vietoms, ji realiuoju laiku stebi visą su jos prekybos kodu vykdomą algoritminės prekybos veiklą, įskaitant jos klientų veiklą, ieškodama netvarkingos prekybos požymių, įskaitant prekybą skirtingose rinkose, skirtingų klasių turtu ar produktais, kai įmonė arba jos klientai tokią veiklą vykdo.

2. Algoritminės prekybos veiklos stebėjimą realiuoju laiku atlieka už prekybos algoritmą arba algoritminės prekybos strategiją atsakingas prekiautojas ir rizikos valdymo funkciją atliekantys darbuotojai arba nepriklausomą rizikos kontrolės funkciją atliekantys darbuotojai, jei tokia funkcija buvo nustatyta taikant šią nuostatą. Ta rizikos kontrolės funkcija laikoma nepriklausoma, nepaisant to, ar stebėjimą realiuoju laiku atlieka investicinės įmonės darbuotojas, ar trečioji šalis, jeigu ją atliekantis asmuo yra hierarchiškai nepriklausomas nuo prekiautojo ir gali jo veiksmus sustabdyti, kai tai tinkama ir būtina pagal 1 straipsnyje nurodytą valdymo sistemą.

3. Už stebėjimą realiuoju laiku atsakingi darbuotojai laiku reaguoja į veiklos ir reguliavimo problemas ir prireikus inicijuoja taisomuosius veiksmus.

4. Investicinė įmonė užtikrina, kad kompetentinga institucija, atitinkamos prekybos vietos ir atitinkamais atvejais TEP teikėjai, tarpuskaitos nariai ir pagrindinės sandorio šalys bet kuriuo metu galėtų susisiekti su darbuotojais, atsakingais už stebėjimą realiuoju laiku. Tuo tikslu investicinė įmonė nustato ir reguliariai testuoja savo ryšių kanalus, įskaitant savo kontaktines procedūras ne prekybos valandomis, kad kritinėmis aplinkybėmis užtikrintų darbuotojų, turinčių tinkamo lygio įgaliojimus, susisiekimą laiku.

5. Stebėjimo realiuoju laiku sistemose įdiegiami įspėjimai realiuoju laiku, padedantys darbuotojams nustatyti nenumatytą prekybos veiklą, vykdomą pagal algoritmą. Investicinė įmonė nustato procesą, kurio laikantis kuo skubiau po įspėjimo sugeneravimo imamasi taisomųjų veiksmų, prireikus apimančių ir tvarkingą pašalinimą iš rinkos. Tos sistemos taip pat teikia įspėjimus, susijusius su algoritmais ir TEP pavedimais, dėl kurių aktyvuojami prekybos vietos sistemos išjungikliai. Įspėjimai sugeneruojami realiuoju laiku per penkias sekundes po atitinkamo įvykio.

17 straipsnis

Kontrolė sudarius sandorį

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė nuolatos vykdo nustatytą kontrolę sudarius sandorį. Prireikus naudoti kontrolės priemones, taikytinas sudarius sandorį, investicinė įmonė imasi tinkamų veiksmų, kurie, be kita ko, gali apimti atitinkamo prekybos algoritmo arba prekybos sistemos koregavimą ar išjungimą arba tvarkingą pašalinimą iš rinkos.

2. 1 dalyje nurodyta kontrolė sudarius sandorį apima nuolatinį investicinės įmonės faktinės pozicijos rinkos ir kredito rizikos vertinimą ir stebėjimą.

3. Investicinė įmonė saugo išsamius, tikslius ir nuoseklius savo prekybos ir apskaitos informacijos įrašus. Investicinė įmonė sutikrina savo elektroninės prekybos žurnalus su prekybos vietų, kurioms siunčia pavedimus, savo maklerių ar TEP teikėjų, tarpuskaitos narių ar pagrindinių sandorio šalių, duomenų teikėjų ar kitų susijusių verslo partnerių pateikta informacija apie jos neįvykdytus pavedimus ir rizikos pozicijas. Sutikrinimas atliekamas realiuoju laiku, kai minėti rinkos dalyviai informaciją teikia realiuoju laiku. Investicinė įmonė gali realiuoju laiku apskaičiuoti savo neapmokėtą poziciją ir savo prekiautojų bei klientų neapmokėtą poziciją.

4. Išvestinių finansinių priemonių atveju 1 dalyje nurodyta kontrolė sudarius sandorį apima ilgųjų, trumpųjų ir bendrų strateginių pozicijų patikrinimą pagal prekybos ribas, nustatytinas susijusių finansinių priemonių rūšis atitinkančiais vienetais.

5. Stebėjimą sudarius sandorį atlieka už algoritmą atsakingi prekiautojai ir investicinės įmonės rizikos kontrolės funkciją atliekantys darbuotojai.

18 straipsnis

Saugumas ir prieigos ribojimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 1 dalis)

1. Investicinė įmonė įgyvendina IT strategiją, kurioje apibrėžti tikslai ir priemonės:

a) atitinka investicinės įmonės verslo ir rizikos strategiją, taip pat yra pritaikyti prie jos operacinės veiklos ir jai gresiančios rizikos;

b) yra grindžiami patikima IT struktūra, įskaitant aptarnavimą, našumą ir kūrimą;

c) atitinka veiksmingą IT saugumo valdymą.

2. Investicinė įmonė nustato ir prižiūri tinkamas fizinio ir elektroninio saugumo priemones, mažinančias išpuolių prieš jos informacines sistemas riziką ir apimančias veiksmingą tapatybės ir prieigos valdymą. Tomis priemonėmis užtikrinamas duomenų konfidencialumas, vientisumas, autentiškumas ir prieinamumas bei investicinės įmonės informacinių sistemų patikimumas ir atsparumas.

3. Investicinė įmonė nedelsdama kompetentingai institucijai praneša apie visus esminius jos fizinio ir elektroninio saugumo priemonių pažeidimus. Ji pateikia kompetentingai institucijai incidento ataskaitą, kurioje nurodomas incidento pobūdis, reaguojant į incidentą taikytos priemonės ir panašių incidentų pasikartojimo prevencijos iniciatyvos.

4. Imituodama kibernetinių išpuolių situacijas, investicinė įmonė kiekvienais metais atlieka skverbties bandymus ir pažeidžiamumo patikras.

5. Investicinė įmonė užtikrina, kad būtų pajėgi nustatyti visų asmenų, turinčių svarbiausių naudotojų prieigos prie jos IT sistemų teises, tapatybę. Investicinė įmonė apriboja tokių asmenų skaičių ir, siekdama bet kuriuo metu užtikrinti jų atsekamumą, stebi jų prieigą prie IT sistemų.

III SKYRIUS

TIESIOGINĖ ELEKTRONINĖ PRIEIGA

19 straipsnis

Bendrosios TEP nuostatos

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalis)

TEP teikėjas nustato politiką ir procedūras, kuriomis užtikrinama, kad jo TEP klientų prekyba atitiktų prekybos vietos taisykles, taip užtikrinant, kad TEP teikėjas atitiktų reikalavimus pagal Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalį.

20 straipsnis

TEP teikėjų vykdoma kontrolė

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalis)

1. TEP teikėjas vykdo kiekvieno savo TEP kliento pavedimų srauto kontrolę, nurodytą 13, 15 ir 17 straipsniuose, ir stebėjimą realiuoju laiku, nurodytą 16 straipsnyje. Ta kontrolė ir tas stebėjimas yra atskiri ir nesusiję su TEP klientų vykdoma kontrole ir stebėjimu. Visų pirma visada atliekama TEP kliento pavedimų kontrolė prieš sudarant sandorį, kurią nustato ir kontroliuoja TEP teikėjas.

2. TEP teikėjas gali naudotis savo atliktos kontrolės prieš sudarant ir sudarius sandorį, trečiosios šalies arba prekybos vietos atliktos kontrolės ir stebėjimo realiuoju laiku rezultatais. Visais atvejais TEP teikėjas yra atsakingas už tos kontrolės veiksmingumą. TEP teikėjas taip pat užtikrina, kad turėtų išimtinę teisę nustatyti ar keisti tos kontrolės prieš sudarant ir sudarius sandorį ir stebėjimo realiuoju laiku parametrus ar ribas. TEP teikėjas nuolatos stebi vykdomą kontrolę prieš sudarant ir sudarius sandorį.

3. Atliekant kontrolę prieš sudarant sandorį pavedimų pateikimui taikomos ribos yra grindžiamos kredito ir rizikos ribomis, kurias TEP teikėjas taiko savo TEP klientų prekybos veiklai. Tos ribos grindžiamos TEP klientų pradinio išsamaus patikrinimo ir periodiškos peržiūros, kuriuos atlieka TEP teikėjas, rezultatais.

4. TEP klientų, naudojančių suteiktąją prieigą, kontrolės parametrai ir ribos yra tokie patys griežti kaip ir TEP klientų, naudojančių TPR, kontrolės parametrai ir ribos.

21 straipsnis

TEP teikėjų sistemų specifikacijos

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalis)

1. TEP teikėjas užtikrina, kad jo prekybos sistemos sudarytų jam sąlygas:

a) stebėti pavedimus, kuriuos TEP klientas pateikia naudodamas TEP teikėjo prekybos kodą;

b) automatiškai blokuoti ar anuliuoti pavedimus, kuriuos pateikė prekybos sistemas, pateikiančias su algoritmine prekyba susijusius pavedimus, valdantys asmenys, kurie neturi leidimo siųsti pavedimų per TEP;

c) automatiškai blokuoti ar anuliuoti pavedimus, kuriuos pateikė TEP klientas dėl finansinių priemonių, kuriomis prekiauti tas klientas neturi leidimo, naudodamos vidaus žymėjimo sistemą atskiriems TEP klientams arba TEP klientų grupei identifikuoti ir užblokuoti;

d) automatiškai blokuoti ar anuliuoti TEP kliento pateiktus pavedimus, kurie neatitinka TEP teikėjo rizikos valdymo ribų, vykdydamos atskirų TEP klientų, finansinių priemonių arba TEP klientų grupių pozicijų kontrolę;

e) sustabdyti pavedimų srautus, siunčiamus jo TEP klientų;

f) laikinai sustabdyti arba nutraukti TEP paslaugų teikimą bet kuriam TEP klientui, kai TEP teikėjas nėra įsitikinęs, kad tolesnė prieiga atitiktų jo taisykles ir procedūras, kuriomis užtikrinama sąžininga ir tvarkinga prekyba ir rinkos vientisumas;

g) prireikus atlikti TEP klientų vidaus rizikos kontrolės sistemų peržiūrą.

2. TEP teikėjas nustato procedūras, pagal kurias vertinamas, valdomas ir švelninamas rinkos veikimo sutrikdymas ir įmonei būdinga rizika. TEP teikėjas gali identifikuoti asmenis, kuriems reikia pranešti įvykus klaidai, dėl kurios pažeidžiamas rizikos pobūdis arba gali būti pažeistos prekybos vietos taisyklės.

3. TEP teikėjas visuomet gali pagal priskirtus unikalius identifikavimo kodus identifikuoti skirtingus savo TEP klientus, jų sandorius sudarančius darbuotojus ir prekiautojus, pateikiančius pavedimus per TEP teikėjo sistemas.

4. TEP teikėjas, leidžiantis TEP klientui teikti savo TEP prieigą savo klientams (perįgaliojimas), turi galimybę identifikuoti skirtingus pavedimų srautus, kuriuos sukuria tokio perįgaliojimo gavėjai, tačiau nėra įpareigotas žinoti tokio susitarimo naudos gavėjų tapatybės.

5. TEP teikėjas fiksuoja duomenis, susijusius su savo TEP klientų pateiktais pavedimais, įskaitant pakeitimus ir anuliavimus, savo stebėjimo sistemų sugeneruotus įspėjimus ir atliktus filtravimo proceso pakeitimus.

22 straipsnis

Būsimų TEP klientų išsamus patikrinimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalis)

1. TEP teikėjas atlieka savo būsimų TEP klientų išsamų patikrinimą, kad užtikrintų jų atitiktį šiame reglamente nustatytiems reikalavimams ir prekybos vietos, kurios prieigą jis siūlo, taisyklėms.

2. Atliekant 1 dalyje nurodytą išsamų patikrinimą, tikrinama:

a) būsimo TEP kliento valdymo ir nuosavybės struktūra;

b) būsimo TEP kliento naudojamų strategijų rūšys;

c) būsimo TEP kliento veiklos struktūra, sistemos, kontrolė prieš sudarant ir sudarius sandorį ir stebėjimas realiuoju laiku. TEP siūlanti investicinė įmonė, leidžianti TEP klientams naudotis trečiųjų šalių programine prekybos įranga prieigai prie prekybos vietų, užtikrina, kad ta programinė įranga apimtų kontrolę prieš sudarant sandorį, atitinkančią šiame reglamente tokiai kontrolei nustatytus reikalavimus;

d) būsimo TEP kliento atsakomybės sritys, susijusios su veiksmais ir klaidomis;

e) būsimo TEP kliento ankstesni prekybos modeliai ir elgsena;

f) būsimo TEP kliento numatomas prekybos lygis ir pavedimų apimtis;

g) būsimo TEP kliento pajėgumas vykdyti savo finansinius įsipareigojimus TEP teikėjo atžvilgiu;

h) būsimo TEP kliento drausmės istorija, jei yra.

3. Perįgaliojimą leidžiantis TEP teikėjas užtikrina, kad prieš jam suteikiant prieigą būsimas TEP klientas įdiegtų išsamaus patikrinimo sistemą, atitinkančią bent 1 ir 2 dalyse nustatytus reikalavimus.

23 straipsnis

TEP klientų periodiškos peržiūros

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 5 dalis)

1. TEP teikėjas kiekvienais metais peržiūri savo išsamaus patikrinimo procesus.

2. TEP teikėjas kiekvienais metais pagal riziką iš naujo įvertina savo klientų sistemų ir kontrolės tinkamumą, visų pirma atsižvelgdamas į jų prekybos veiklos ar strategijų masto, pobūdžio ar sudėtingumo pokyčius, personalo, nuosavybės struktūros, prekybos ar banko sąskaitos, reguliavimo statuso bei finansinės būklės pokyčius ir tai, ar TEP klientas yra pareiškęs ketinimą perįgalioti kitą subjektą naudotis prieiga, kurią jam suteikė TEP teikėjas.

IV SKYRIUS

INVESTICINĖS ĮMONĖS, VEIKIANČIOS KAIP BENDROSIOS TARPUSKAITOS NARĖS

24 straipsnis

Investicinių įmonių, veikiančių kaip bendrosios tarpuskaitos narės, sistemos ir kontrolė

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 6 dalis)

Atliekamas visų sistemų, kurias investicinės įmonės, veikiančios kaip bendrosios tarpuskaitos narės (toliau – tarpuskaitos įmonės), naudoja savo tarpuskaitos paslaugoms teikti savo klientams, tinkamas išsamus patikrinimas, kontrolė ir stebėjimas.

25 straipsnis

Būsimų tarpuskaitos klientų išsamūs patikrinimai

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 6 dalis)

1. Tarpuskaitos įmonė atlieka būsimo tarpuskaitos kliento pradinį vertinimą, atsižvelgdama į būsimo tarpuskaitos kliento veiklos pobūdį, mastą ir sudėtingumą. Vertinant kiekvieną būsimą tarpuskaitos klientą taikomi šie kriterijai:

a) kreditingumas (angl. *credit strength*), įskaitant visas suteiktas garantijas;

b) vidaus rizikos kontrolės sistemos;

c) planuojama prekybos strategija;

d) mokėjimo sistemos ir susitarimai, sudarantys sąlygas būsimam tarpuskaitos klientui užtikrinti turto ar pinigų, kaip garantinės įmokos, kurios reikalauja tarpuskaitos įmonė dėl teikiamų tarpuskaitos paslaugų, perdavimą laiku;

e) sistemos nustatymai ir prieiga prie informacijos, padedantys būsimam tarpuskaitos klientui laikytis bet kokios didžiausios prekybos ribos, suderintos su tarpuskaitos įmone;

f) bet koks įkaitas, būsimo tarpuskaitos kliento pateiktas tarpuskaitos įmonei;

g) veiklos ištekliai, įskaitant technologines sąsajas ir prisijungimo galimybes;

h) bet koks būsimo tarpuskaitos kliento dalyvavimas pažeidžiant taisykles, kuriomis užtikrinamas finansų rinkų vientisumas, įskaitant dalyvavimą vykdant piktnaudžiavimo rinka nusižengimą, finansinį nusikaltimą ar pinigų plovimo veiklą.

2. Tarpuskaitos įmonė kiekvienais metais peržiūri savo tarpuskaitos klientų faktinius rezultatus pagal 1 dalyje nurodytus kriterijus. Privalomame rašytiniame susitarime, nurodytame Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 6 dalyje, nurodomi šie kriterijai ir periodiškumas, kuriuo tarpuskaitos įmonė pagal tuos kriterijus peržiūri savo tarpuskaitos klientų rezultatus, kai ta peržiūra atliktina dažniau nei kartą per metus. Privalomame rašytiniame susitarime nurodomos pasekmės, kurias tarpuskaitos klientai patirs, jei šių kriterijų nesilaikys.

26 straipsnis

Pozicijų ribos

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 6 dalis)

1. Tarpuskaitos įmonė nustato ir savo tarpuskaitos klientams praneša tinkamas prekybos ir pozicijų ribas, taikytinas siekiant sumažinti ir valdyti savo sandorio šalies, likvidumo, operacinę ir kitą riziką.

2. Tarpuskaitos įmonė stebi savo tarpuskaitos klientų pozicijų atitiktį 1 dalyje nurodytoms riboms beveik realiuoju laiku, kiek tai įmanoma, ir, taikydama tinkamą garantinių įmokų praktiką ir kitas tinkamas priemones, pozicijų ribų nesilaikymo rizikai valdyti nustato tinkamas procedūras prieš sudarant ir sudarius sandorį.

3. Tarpuskaitos įmonė raštiškai įformina 2 dalyje nurodytas procedūras ir fiksuoja, ar tarpuskaitos klientai tų procedūrų laikosi.

27 straipsnis

Informacijos apie teikiamas paslaugas atskleidimas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 6 dalis)

1. Tarpuskaitos įmonė paskelbia sąlygas, kuriomis ji siūlo savo tarpuskaitos paslaugas. Šias paslaugas ji siūlo teikti pagrįstomis komercinėmis sąlygomis.

2. Tarpuskaitos įmonė informuoja savo būsimus ir esamus tarpuskaitos klientus apie apsaugos ir sąnaudų, susijusių su jos teikiamais skirtingais atskyrimo lygiais, dydžius. Informacija apie skirtingus atskyrimo lygius apima pagrindinio teisinio poveikio, kurį gali daryti siūlomi atitinkami atskyrimo lygiai, aprašymą, įskaitant informaciją apie atitinkamoje jurisdikcijoje taikomą bankroto teisę.

V SKYRIUS

DIDELIO DAŽNIO ALGORITMINĖS PREKYBOS METODAS IR BAIGIAMOSIOS NUOSTATOS

28 straipsnis

Pavedimų įrašų turinys ir formatas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 2 dalis)

1. Didelio dažnio algoritminės prekybos metodą taikanti investicinė įmonė iš karto po pavedimo pateikimo fiksuoja kiekvieno pateikto pavedimo duomenis II priedo 2 ir 3 lentelėse pateiktu formatu.

2. Didelio dažnio algoritminės prekybos metodą taikanti investicinė įmonė atnaujina 1 dalyje nurodytus duomenis pagal standartus ir formatus, nurodytus II priedo 2 ir 3 lentelių ketvirtoje skiltyje.

3. 1 ir 2 dalyse nurodyti įrašai saugomi penkerius metus nuo pavedimo pateikimo vykdyti prekybos vietai ar kitai investicinei įmonei datos.

29 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

(Direktyvos 2014/65/ES 17 straipsnio 2 dalis)

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

Jis taikomas nuo 2018 m. sausio 3 d.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2016 m. liepos 19 d.

Komisijos vardu
Pirmininkas
Jean-Claude JUNCKER

I PRIEDAS

Investicinės įmonės įsivertinimo kriterijai, kaip nurodyta 9 straipsnio 1 dalyje

1. Vertindama savo veiklos pobūdį investicinė įmonė atsižvelgia į šiuos veiksnius (kai yra):

   a) įmonės ir atitinkamais atvejais jos TEP klientų reguliavimo statusą, įskaitant jai, kaip investicinei įmonei, pagal Direktyvą 2014/65/ES taikomus reguliavimo reikalavimus ir kitus atitinkamus reguliavimo reikalavimus;

   b) įmonės vaidmenis rinkoje, įskaitant tai, ar ji yra rinkos formuotoja ir ar vykdo klientų pavedimus, ar tik prekiauja savo sąskaita;

   c) įmonės prekybos ir kitų procesų ar veiklos automatizacijos lygį;

   d) finansinių priemonių, produktų ir turto klasių, kuriais prekiauja įmonė, rūšis ir reguliavimo statusą;

   e) įmonės taikomų strategijų rūšis ir šių strategijų keliamą riziką pačios įmonės rizikos valdymui bei sąžiningam ir tvarkingam rinkų veikimui; visų pirma įmonė atsižvelgia į šių strategijų pobūdį, pavyzdžiui, rinkos formavimą arba arbitražą, ir tai, ar tos strategijos yra ilgalaikės, trumpalaikės, kryptinės ar nekryptinės;

   f) įmonės strategijų ir prekybos veiklos jautrumą delsai;

   g) prekybos vietų ir kitų likvidumo fondų, prie kurių jungiamasi, rūšį ir reguliavimo statusą, visų pirma tai, ar prekybos veikla tose prekybos vietose ir kituose likvidumo fonduose yra vieša, nevieša anoniminė ar nebiržinė;

   h) įmonės ryšių sprendimus ir tai, ar ji jungiasi prie prekybos vietų kaip narė, TEP klientė ar TEP teikėja;

   i) mastą, kuriuo įmonė pasikliauja trečiosiomis šalimis kurdama ir prižiūrėdama savo algoritmus ar prekybos sistemas, ir ar tie algoritmai ar prekybos sistemos yra kuriami įmonėje, kuriami bendradarbiaujant su trečiosiomis šalimis, perkami iš trečiosios šalies, ar jai patikėti;

   j) įmonės nuosavybės ir valdymo struktūrą, jos organizacinę ir veiklos struktūrą ir tai, ar ji yra ūkinė bendrija, patronuojamoji įmonė, biržinė bendrovė ar kitos formos subjektas;

   k) įmonės rizikos valdymo, atitikties užtikrinimo ir audito struktūrą ir organizavimą;

   l) įmonės įsisteigimo datą, jos personalo patirties ir kompetencijos lygį ir tai, ar ji įsteigta neseniai.

2. Vertindama savo veiklos mastą investicinė įmonė atsižvelgia į šiuos veiksnius (kai yra):

   a) vienu metu veikiančių algoritmų ir vykdomų strategijų skaičių;

   b) atskirų finansinių priemonių, produktų ir turto klasių, kuriais prekiaujama, skaičių;

   c) naudojamų prekybos operacijų sąrašų ir už pavedimų vykdymą atsakingų fizinių asmenų bei algoritmų naudojamų atskirų prekybos identifikatorių skaičių;

   d) pranešimų kiekio pajėgumą ir visų pirma pateikiamų, pakoreguotų, anuliuotų ir įvykdytų pavedimų skaičių;

   e) įmonės bruto ir neto vienos dienos ir vienos nakties pozicijų piniginę vertę;

   f) rinkų, kuriose įmonė veikia kaip narė ar dalyvė arba per TEP, skaičių;

   g) įmonės klientų ir ypač TEP klientų skaičių ir dydį;

   h) kolokacijos arba artimosios prieglobos tinklaviečių, su kuriomis įmonė turi ryšį, skaičių;

   i) įmonės ryšių infrastruktūros pralaidumą;

j) įmonės tarpuskaitos narių arba PSŠ narysčių skaičių;

k) įmonės dydį pagal prekiautojų ir sandorius vykdančių darbuotojų, rizikos valdymo skyriaus darbuotojų ir administracijos darbuotojų (angl. *front-office, middle-office and back-office staff*) etato ekvivalentų skaičių;

l) įmonės fizinių vietų skaičių;

m) šalių ir regionų, kuriose įmonė vykdo prekybos veiklą, skaičių;

n) įmonės metines pajamas ir pelną.

3. Vertindama savo veiklos sudėtingumą investicinė įmonė atsižvelgia į šiuos veiksnius (kai yra):

a) įmonės arba jos klientų taikomų strategijų pobūdį tiek, kiek įmonė tas strategijas žino, visų pirma tai, ar pagal tas strategijas numatomi algoritmai, aktyvuojantys pavedimus, susijusius su koreliuotomis finansinėmis priemonėmis arba vykdomus keliose prekybos vietose ar su keliais likvidumo fondais;

b) įmonės algoritmus, t. y. jų koduotes, įvesties duomenis, kuriais jie grindžiami, tarpusavio priklausomybę ir algoritmuose įrašytas taisyklių išimtis bei kt.;

c) įmonės prekybos sistemas, t. y. naudojamų prekybos sistemų įvairovę ir mastą, kuriuo įmonė kontroliuoja jų nustatymus, koregavimą, testavimą ir peržiūrą;

d) įmonės struktūrą, t. y. nuosavybės ir valdymo struktūrą, organizacinę, veiklos, techninę, fizinę ar geografinę struktūrą;

e) įmonės ryšių, technologinių ar tarpuskaitos sprendimų įvairovę;

f) įmonės fizinių prekybos infrastruktūrų įvairovę;

g) įmonės naudojamų arba siūlomų trečiosioms šalims patikėtų paslaugų lygį, visų pirma tai, ar pagrindinės funkcijos yra patikėtos trečiosioms šalims;

h) įmonės teikiamą arba naudojamą TEP, nurodant, ar tai yra tiesioginė prieiga prie rinkos (TPR), ar suteiktoji prieiga, ir sąlygas, kuriomis TEP yra siūloma klientams;

i) įmonės ar jos klientų prekybos greitį.

II PRIEDAS

Pavedimų įrašų turinys ir formatas, kaip nurodyta 28 straipsnyje

1 lentelė

2 ir 3 lentelių paaiškinimai

SIMBOLIS	DUOMENŲ RŪŠIS	APIBRĖŽTIS
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių 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	Skaitiniame laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės: — dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku); — neigiami skaičiai nurodomi su „–“ (minusu); — vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{INTEGER-n}	Sveikąjį skaičių sudaro iš viso iki n skaitmenų	Skaitiniame laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos sveikojo skaičiaus vertės.
{ISIN}	12 raidinių skaitinių ženklų	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{LEI}	20 raidinių skaitinių ženklų	Juridinio asmens identifikatorius pagal ISO 17442.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.
{NATIONAL_ID}	35 raidiniai skaitiniai ženklai	Identifikatorius nurodytas [22 TRS dėl pranešimo apie sandorius pareigų pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 26 straipsnį] 6 straipsnyje ir II priede.

2 lentelė

Informacija, susijusi su kiekvienu pirminiu sprendimu prekiauti ir klientų įvedamais pavedimais

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
1	Kliento vardas (-ai)	Nesutrumpintas (-i) kliento vardas (-ai). Jei vardų daugiau nei vienas, šiame laukelyje nurodomi visi vardai, atskirti kableliu. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei taikomas juridinio asmens identifikatorius (LEI).	{ALPHANUM-140}

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
2	Kliento pavardė (-ės)	Nesutrumpinta (-os) kliento pavardė (-ės). Jei pavardžių daugiau nei viena, šiame laukelyje nurodomos visos pavardės, atskirtos kableliu. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei taikomas LEI.	{ALPHANUM-140}
3	Kliento identifikavimo kodas	Kodas, naudojamas investicinės įmonės klientui identifikuoti. Jei yra TEP, naudojamas TEP vartotojo kodas. Jei klientas yra juridinis asmuo, naudojamas kliento LEI kodas. Jei klientas nėra juridinis asmuo, naudojamas kodas {NATIONAL_ID}. Jungtinių pavedimų atveju naudojama žyma „AGGR“, kaip nurodyta Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/580 ([1]) 2 straipsnio 3 dalyje. Dar nepaskirtų pavedimų atveju naudojama žyma „PNAL“, kaip nurodyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/580 2 straipsnio 2 dalyje. Šis laukelis paliekamas tuščias tik tuomet, jei investicinė įmonė klientų neturi.	{LEI} {NATIONAL_ID} AGGR – jungtiniai pavedimai PNAL – dar nepaskirti pavedimai
4	Kliento vardu veikiančio asmens vardas (-ai)	Šiame laukelyje nurodomas nesutrumpintas (-i) asmens, veikiančio kliento vardu, vardas (-ai). Jei vardų daugiau nei vienas, šiame laukelyje nurodomi visi vardai, atskirti kableliu.	{ALPHANUM-140}
5	Kliento vardu veikiančio asmens pavardė (-ės)	Šiame laukelyje nurodomos nesutrumpinta (-os) asmens, veikiančio kliento vardu, pavardė (-ės). Jei pavardžių daugiau nei viena, šiame laukelyje nurodomos visos pavardės, atskirtos kableliu.	{ALPHANUM-140}
6	Investicinis sprendimas įmonėje	Kodas, naudojamas investicinės įmonės asmeniui arba algoritmui, kuriam tenka atsakomybė už investicinį sprendimą pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 ([2]) 8 straipsnį, identifikuoti. Jei atsakomybė už investicinį sprendimą teko fiziniam asmeniui, tas asmuo, kuris buvo atsakingas arba kuriam teko pagrindinė atsakomybė už investicinį sprendimą, identifikuojamas kodu {NATIONAL_ID}. Jei atsakomybė už investicinį sprendimą teko algoritmui, laukelis pildomas, kaip nustatyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 8 straipsnyje. Šis laukelis paliekamas tuščias, kai investicinį sprendimą priėmė ne investicinės įmonės asmuo ar algoritmas.	{NATIONAL_ID} – fiziniai asmenys {ALPHANUM-50} – algoritmai
7	Pirminio pavedimo identifikatorius	Kodas, pagal kurį identifikuojamas pavedimas, gautas iš kliento arba sukurtas investicinės įmonės prieš jį tvarkant ir pateikiant prekybos vietai ar investicinei įmonei.	{ALPHANUM-50}
8	Nuoroda pirkti arba parduoti	Parodyti, ar pavedimas yra pirkti, ar parduoti.	BUYI – pirkti SELL – parduoti

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
		Pasirinkimo sandorių ir pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, turinti teisę vykdyti pasirinkimo sandorį, o pardavėjas yra sandorio šalis, kuri parduoda pasirinkimo sandorį ir gauna priedą. Ateities ir išankstinių sandorių atveju, išskyrus su valiutomis susijusius ateities ir išankstinius sandorius, pirkėjas yra sandorio šalis, perkanti priemonę, o pardavėjas – sandorio šalis, parduodanti priemonę. Su vertybiniais popieriais susijusių apsikeitimo sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, kuriai tenka pagrindinio vertybinio popieriaus kainos kitimo rizika ir kuri gauna vertybinio popieriaus sumą. Pardavėjas yra sandorio šalis, sumokanti vertybinio popieriaus sumą. Su palūkanų normomis arba infliacijos indeksais susijusių apsikeitimo sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, mokanti fiksuotąją normą. Pardavėjas yra sandorio šalis, gaunanti fiksuotąją normą. Valiutų pozicijų apsikeitimo sandorių (kintama palūkanų norma už kintamą palūkanų normą) atveju pirkėjas yra sandorio šalis, kuri moka pirkimo ir pardavimo kainų skirtumą, o pardavėjas – sandorio šalis, kuri tą skirtumą gauna. Apsikeitimo ir išankstinių sandorių, susijusių su valiutomis, ir skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, gaunanti valiutą, kurios kodas abėcėlės tvarka pagal ISO 4217 standartą yra pirmas, o pardavėjas yra sandorio šalis, pateikianti tą valiutą. Su dividendais susijusių apsikeitimo sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, gaunanti lygiaverčius faktinius dividendų mokėjimus. Pardavėjas yra sandorio šalis, mokanti dividendus ir gaunanti fiksuotąją normą. Kredito rizikos perleidimo išvestinių finansinių priemonių atveju, išskyrus pasirinkimo sandorius ir pasirinkimo sandorius dėl apsikeitimo sandorių, pirkėjas yra sandorio šalis, perkanti apsaugą. Pardavėjas yra sandorio šalis, parduodanti apsaugą. Su biržos prekėmis arba apyvartiniais taršos leidimais susijusių išvestinių finansinių priemonių sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, gaunanti pranešime nurodytą biržos prekę arba apyvartinį taršos leidimą, o pardavėjas – sandorio šalis, pateikianti šią biržos prekę arba apyvartinį taršos leidimą. Išankstinių palūkanų normų sandorių atveju pirkėjas yra sandorio šalis, mokanti fiksuotąją normą, o pardavėjas – sandorio šalis, gaunanti fiksuotąją normą. Tariamosios sumos padidėjimo atveju pirkėjas yra tas pats asmuo, kaip pradinio sandorio finansinės priemonės įgijėjas, o pardavėjas – tas pats asmuo, kaip pradinio sandorio finansinės priemonės perleidėjas. Tariamosios sumos sumažėjimo atveju pirkėjas yra tas pats asmuo, kaip pradinio sandorio finansinės priemonės perleidėjas, o pardavėjas – tas pats asmuo, kaip pradinio sandorio finansinės priemonės įgijėjas.	
9	Finansinės priemonės identifikavimo kodas	Unikalus ir vienareikšmis finansinės priemonės identifikatorius	{ISIN}

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
10	Kaina	Pavedimo limituota kaina atitinkamais atvejais be komisinių ir sukauptų palūkanų. Nuostolio stabdymo pavedimų atveju tai pavedimo nuostolio stabdymo kaina. Pasirinkimo sandorių atveju kaina yra išvestinės finansinės priemonės sandorio priedas vienai pagrindinei finansinei priemonei arba indekso punktui. Kainų skirtumo lažybų sandorių (angl. *spread bets*) atveju kaina yra tiesioginės pagrindinės finansinės priemonės referencinė kaina. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju kaina yra atkarpa baziniais punktais. Kai kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. Kai kaina netaikoma, laukelyje įrašoma vertė „NOAP“. Kai kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, įrašoma vertė „PNDG“. Kai sutarta kaina lygi nuliui, naudojama nulinė kaina. Atitinkamais atvejais vertės nėra nei apvalinamos, nei trumpinamos.	{DECIMAL-18/13} – jei kaina išreikšta pinigine verte {DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais PNDG – jei kaina nežinoma NOAP – jei kaina netaikoma
11	Kainos žymėjimas	Nurodoma, ar kaina ir vykdymo kaina išreikštos pinigine verte, procentine dalimi, pajamingumu, ar baziniais punktais.	MONE – piniginė vertė PERC – procentinė dalis YIEL – pajamingumas BAPO – baziniai punktai
12	Kainos daugiklis	Pagrindinių finansinių priemonių, kurias atspindi viena išvestinių finansinių priemonių sutartis, vienetų skaičius. Piniginė vertė, kurią atitinka viena apsikeitimo sandorio sutartis, kai kiekio laukelyje įrašytas apsikeitimo sandorio sutarčių skaičius. Su indeksu susieto ateities sandorio arba pasirinkimo sandorio atveju nurodoma indekso punkto suma. Skirtumo lažybų atveju nurodomas pagrindinės finansinės priemonės, dėl kurios lažinamasi, kainos pokytis. Šiame laukelyje pateikta informacija turi atitikti 10 ir 26 laukeliuose pateiktas vertes.	{DECIMAL- 18/17} 1 – jei neišvestinėmis finansinėmis priemonėmis neprekiaujama pagal sutartis
13	Kainos valiuta	Valiuta, kuria išreikšta su pavedimu susijusios finansinės priemonės kaina (taikytina, kai kaina išreikšta pinigine verte).	{CURRENCYCODE_3}
14	Sandorio 2 dalies valiuta	Kelių valiutų arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių atveju sandorio 2 dalies valiuta yra ta, kuria denominuota sandorio 2 dalis. Pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju, kai pagrindinis apsikeitimo sandoris vykdomas keliomis valiutomis, nurodoma valiuta, kuria denominuota apsikeitimo sandorio 2 sandorio dalis. Šis laukelis taikytinas tik palūkanų normos ir valiutos išvestinių finansinių priemonių sandoriams.	{CURRENCYCODE_3}

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
15	Pagrindinės finansinės priemonės kodas	Pagrindinės finansinės priemonės ISIN kodas. Amerikos depozitoriumo pakvitavimų (ADR), tarptautinių depozitoriumo pakvitavimų (GDR) ir panašių finansinių priemonių atveju nurodomas finansinės priemonės, kuria grindžiamos šios priemonės, {ISIN} kodas. Konvertuojamųjų obligacijų atveju nurodomas priemonės, į kurią gali būti konvertuota obligacija, {ISIN} kodas. Išvestinių finansinių priemonių ar kitų priemonių, kurios turi pagrindinę finansinę priemonę, atveju nurodomas pagrindinės finansinės priemonės ISIN kodas, kai pagrindine finansine priemone leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje. Jei pagrindinė finansinė priemonė yra dividendai akcijomis, nurodomas susijusios akcijos, suteikiančios teisę į pagrindinius dividendus, ISIN kodas. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju nurodomas išvestinės finansinės priemonės pagrindinės pozicijos ISIN kodas. Jeigu pagrindinė finansinė priemonė yra indeksas, turintis ISIN kodą, nurodomas to indekso ISIN kodas. Jei pagrindinė finansinė priemonė yra kelių priemonių rinkinys, nurodomi visų to rinkinio sudedamųjų dalių, kuriomis leista prekiauti arba yra prekiaujama prekybos vietoje, visi ISIN kodai. Šis laukelis kartojamas tol, kol išvardijamos visos rinkinio priemonės, apie kurias reikia teikti informaciją.	{ISIN}
16	Pasirinkimo sandorio rūšis	Nurodoma, ar išvestinių finansinių priemonių sutartis yra pirkimo (teisė pirkti konkretų pagrindinį turtą), ar pardavimo (teisė parduoti konkretų pagrindinį turtą) sandoris, ar neįmanoma nustatyti, ar jis pavedimo pateikimo metu bus pirkimo, ar pardavimo sandoris. Pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju nurodoma: — PUTO – pardavimo, jei tai gavimo pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorių (angl. *receiver swaption*), kai pirkėjas turi teisę sudaryti apsikeitimo sandorį kaip fiksuotosios normos gavėjas; — CALL – pirkimo, jei tai pirkimo pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorių (angl. *payer swaption*), kai pirkėjas turi teisę sudaryti apsikeitimo sandorį kaip fiksuotosios normos mokėtojas. Viršutinių ir apatinių ribų sandorių atveju nurodoma: — PUTO, kai tai apatinės ribos; — CALL, kai tai viršutinės ribos. Laukelis skirtas tik išvestinėms finansinėms priemonėms, kurios yra pasirinkimo sandoriai arba varantai.	PUTO – pasirinkimo parduoti sandoris CALL – pasirinkimo pirkti sandoris OTHR – kai neįmanoma nustatyti, ar sandoris pirkimo, ar pardavimo
17	Vykdymo kaina	Nurodoma iš anksto nustatyta kaina, kuria turėtojas turės pirkti arba parduoti pagrindinę finansinę priemonę, arba nurodoma, kad kainos pavedimo pateikimo metu nustatyti neįmanoma. Laukelis skirtas tik pasirinkimo sandoriams arba varantams, kurių vykdymo kaina gali būti nustatyta pavedimo pateikimo metu. Kai vykdymo kaina netaikoma, laukelis nepildomas.	{DECIMAL-18/13} – jei kaina išreikšta pinigine verte {DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais PNDG – jei kaina nežinoma
18	Vykdymo kainos valiuta	Vykdymo kainos valiuta.	{CURRENCYCODE_3}

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
19	Išankstinis mokėjimas	Bet kokio išankstinio mokėjimo piniginė vertė, išreikšta pardavėjo gautos ar sumokėtos tariamosios sumos baziniais punktais. Kai pardavėjui mokamas išankstinis mokėjimas, įrašoma teigiama vertė. Kai pardavėjas moka išankstinį mokėjimą, įrašoma neigiama vertė. Išvestinių finansinių priemonių sandorių tariamosios sumos padidėjimo arba sumažėjimo atveju skaičius parodo absoliučiąją pokyčio vertę ir yra išreiškiamas teigiamu skaičiumi.	{DECIMAL-18/5}
20	Pateikimo rūšis	Nurodoma, ar pagal sandorį atsiskaitoma fiziškai, ar pinigais. Kai pateikimo rūšies pavedimo pateikimo metu nustatyti neįmanoma, įrašoma vertė „OPTL“. Laukelį reikia pildyti tik išvestinių finansinių priemonių atveju.	PHYS – atsiskaitoma fiziškai CASH – atsiskaitoma pinigais OPTL – pasirenka sandorio šalis arba nustato trečioji šalis
21	Pasirinkimo sandorio vykdymo būdas	Nurodoma, ar pasirinkimo sandorį galima įvykdyti tik nustatytą datą (europietiškas, azijietiškas pasirinkimo sandoris), kelias iš anksto nustatytas datas (Bermudų pasirinkimo sandoris) ar bet kuriuo metu sutarties galiojimo laikotarpiu (amerikietiškas pasirinkimo sandoris). Šis laukelis skirtas tik pasirinkimo sandoriams.	EURO – europietiškas AMER – amerikietiškas ASIA – azijietiškas BERM – Bermudų OTHR – kitas
22	Išpirkimo data	Finansinės priemonės išpirkimo data. Laukelis skirtas tik skolos priemonėms su nustatyta išpirkimo data.	{DATEFORMAT}
23	Galiojimo pabaigos data	Finansinės priemonės, apie kurią pranešama, galiojimo pabaigos data. Laukelis skirtas tik išvestinėms finansinėms priemonėms su nustatyta galiojimo pabaigos diena.	{DATEFORMAT}
24	Kiekio valiuta	Valiuta, kuria išreikštas kiekis. Laukelis pildomas tik tuomet, jei kiekis išreikštas kaip nominalioji ar piniginė vertė.	{CURRENCYCODE_3}
25	Kiekio žymėjimas	Nurodoma, ar nurodytas kiekis išreikštas vienetų skaičiumi, nominaliąja verte, ar pinigine verte.	UNIT – vienetų skaičius NOML – nominalioji vertė MONE – piniginė vertė
26	Pradinis kiekis	Finansinės priemonės vienetų skaičius arba pavedimo išvestinių finansinių priemonių sandorių skaičius. Finansinės priemonės nominalioji arba piniginė vertė. Kainų skirtumo lažybų sandorių atveju kiekis yra piniginė vertė, kuria lažinamasi, pagrindinės finansinės priemonės vieno punkto pokyčiui. Išvestinių finansinių priemonių sandorių tariamosios sumos padidėjimo arba sumažėjimo atveju skaičius parodo absoliučiąją pokyčio vertę ir yra išreiškiamas teigiamu skaičiumi. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju kiekis yra tariamoji suma, kurios atžvilgiu įgyjama arba suteikiama apsauga.	{DECIMAL-18/17} – jei kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – jei kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte

Nr.	Laukelis	Aprašymas	Standartai ir formatas
27	Data ir laikas	Tiksli pavedimo gavimo data ir laikas arba sprendimo prekiauti priėmimo tiksli data ir laikas. Atitinkamais atvejais šis laukelis pildomas pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 ([3]) 3 straipsnį ir priedo 2 lentelę.	{DATE_TIME_FORMAT} Atitinkamais atvejais skaitmenų po sekundžių skaičius nustatomas pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 priedo 2 lentelę.
28	Kliento pateikta papildoma informacija	Visi kliento investicinei įmonei pateikti nurodymai, parametrai, sąlygos ir kiti duomenys, susiję su pavedimu.	Laisvo pobūdžio tekstas

([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).
([2]) 2016 m. liepos 28 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/590, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas pranešimo apie sandorius kompetentingoms institucijoms techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 449).
([3]) 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).

3 lentelė

Su pateikiamais ir įvykdytais pavedimais susijusi informacija

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
1	Nuoroda pirkti arba parduoti	Nurodoma, ar pavedimas yra pirkti, ar parduoti, kaip nustatyta 2 lentelės 8 laukelio aprašyme.	BUYI – pirkti SELL – parduoti
2	Prekybos pajėgumas	Nurodoma, ar pavedimas pateiktas prekybos vietos nariui, dalyviui arba klientui vykdant tarpininko suderintus sandorius pagal Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 38 dalį, ar vykdant prekybą savo sąskaita pagal Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 6 dalį. Jei pavedimas pateiktas ne prekybos vietos nariui, dalyviui arba klientui vykdant tarpininko suderintus sandorius ar vykdant prekybą savo sąskaita, laukelyje nurodoma, kad sandoris atliktas pagal kitus įgaliojimus.	DEAL – prekyba savo sąskaita MTCH – tarpininko suderinti sandoriai AOTC – bet kurie kiti įgaliojimai
3	Likvidumo užtikrinimo veikla	Nurodoma, ar pavedimas prekybos vietai pateiktas įgyvendinant rinkos formavimo strategiją pagal Direktyvos 2014/65/ES 17 ir 48 straipsnius, ar vykdant kitą veiklą pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/575 ([1]) 3 straipsnį.	TRUE FALSE
4	Vykdymas įmonėje	Kodas, naudojamas identifikuoti investicinės įmonės asmeniui arba algoritmui, kuriam tenka atsakomybė už sandorio vykdymą pagal pavedimą, remiantis Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 9 straipsniu. Jei fizinis asmuo yra atsakingas už sandorio vykdymą, asmuo identifikuojamas kodu {NATIONAL_ID}. Jei atsakomybė už sandorio vykdymą tenka algoritmui, šis laukelis pildomas pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 9 straipsnį.	{NATIONAL_ID} – fiziniai asmenys {ALPHANUM-50} – algoritmai

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
		Jei sandorio vykdymas apima daugiau kaip vieną asmenį ar bendrai asmenis ir algoritmus, investicinė įmonė nustato prekiautoją arba algoritmą, kuriems tenka pagrindinė atsakomybė, kaip nurodyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 9 straipsnyje, ir šiame laukelyje įrašo to prekiautojo arba algoritmo tapatybę. Šis laukelis skirtas tik įvykdytiems pavedimams.	
5	Pavedimo, pateikto prekybos vietai arba kitai investicinei įmonei, identifikavimo kodas	Investicinės įmonės naudojamas vidaus kodas, kuriuo identifikuojamas pavedimas, pateiktas prekybos vietoms arba kitai investicinei įmonei, jeigu tas kodas yra unikalus prekybos dienos ir finansinės priemonės atžvilgiu.	{ALPHANUM-50}
6	Pavedimo identifikavimo kodas, kurį priskyrė kita investicinė įmonė arba prekybos vieta, kuriai pavedimas buvo pateiktas	Raidinis skaitinis kodas, kurį priskyrė kita investicinė įmonė arba prekybos vieta, kuriai investicinė įmonė pateikė vykdyti pavedimą. Į šį laukelį įrašomas identifikavimo kodas, kurį priskyrė ta investicinė įmonė arba prekybos vieta.	{ALPHANUM-50}
7	Pavedimo gavėjo identifikavimo kodas	Investicinės įmonės, kuriai pavedimas buvo perduotas, kodas arba prekybos vietos, kuriai pavedimas buvo perduotas, kodas.	Investicinės įmonės atveju – {LEI} Prekybos vietos atveju – {MIC}
8	Pavedimo rūšis	Prekybos vietai pateikto pavedimo rūšies identifikavimas pagal prekybos vietos specifikacijas.	{ALPHANUM-50}
9	Limituota kaina	Didžiausia kaina, kuria galima vykdyti pirkimo pavedimą, arba mažiausia kaina, kuria galima vykdyti pardavimo pavedimą. Pirkimo ir pardavimo skirtumo kaina, skirta su strategija susietam pavedimui. Ji gali būti neigiama arba teigiama. Pavedimų, kurie neturi limituotos kainos, arba bet kurių pavedimų be nustatytos kainos atveju šis laukelis paliekamas tuščias. Konvertuojamosios obligacijos atveju šiame laukelyje parodoma pavedimui naudojama realioji kaina (švari arba nešvari (angl. *clean or dirty*)). Kai pavedimas yra įvykdytas, investicinė įmonė taip pat fiksuoja kainą, kuria sandoris įvykdytas.	{DECIMAL-18/13} – kai kaina išreikšta pinigine verte Jei kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. {DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais
10	Kainos valiuta	Valiuta, kuria išreikšta su pavedimu susijusios finansinės priemonės prekybos kaina (taikytina, jeigu kaina išreikšta pinigine verte).	{CURRENCYCODE_3}
11	Kainos žymėjimas	Nurodoma, ar kaina ir vykdymo kaina išreikštos pinigine verte, procentine dalimi, pajamingumu, ar baziniais punktais.	MONE – piniginė vertė PERC – procentinė dalis YIEL – pajamingumas BAPO – baziniai punktai
12	Papildoma limituota kaina	Bet kuri kita limituota kaina, kuri gali būti taikoma pavedimui. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{DECIMAL-18/13} – kai kaina išreikšta pinigine verte

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
			Kai kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. {DECIMAL-11/10} – kai kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais
13	Nuostolio stabdymo kaina (angl. *stop price*)	Kaina, kuri turi būti pasiekta, kad pavedimas taptų aktyvus. Nuostolio stabdymo pavedimų, aktyvuotų įvykus įvykiams, kurie nepriklauso nuo finansinės priemonės kainos, atveju šiame laukelyje įrašoma nuostolio stabdymo kaina, lygi nuliui. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{DECIMAL-18/13} – kai kaina išreikšta pinigine verte Kai kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. {DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais
14	Susieta limituota kaina (angl. *pegged limit price*)	Didžiausia kaina, kuria galima vykdyti susietą pirkimo pavedimą, arba mažiausia kaina, kuria galima vykdyti susietą pardavimo pavedimą. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{DECIMAL-18/13} – kai kaina išreikšta pinigine verte Kai kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. {DECIMAL-11/10} – kai kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais
15	Likęs kiekis, įskaitant neatskleistą (angl. *hidden*) kiekį	Bendras kiekis, likęs pavedimų knygoje po dalinio įvykdymo arba bet kurio kito įvykio, turinčio įtakos pavedimui, atveju. Dalinio pavedimo įvykdymo atveju tai yra bendras likęs kiekis po to dalinio įvykdymo. Įvedant pavedimą tai yra pradinis kiekis.	{DECIMAL-18/17} – kai kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – kai kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte
16	Atskleidžiamas kiekis (angl. *displayed quantity*)	Kiekis, kuris yra matomas (priešingai nei neatskleistas kiekis) pavedimų knygoje.	{DECIMAL-18/17} – kai kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – kai kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte
17	Vykdomas kiekis	Dalinio arba visiško įvykdymo atveju šiame laukelyje įrašomas vykdomas kiekis.	{DECIMAL-18/17} – kai kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – kai kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
18	Mažiausias priimtinas kiekis (angl. MAQ)	Mažiausias priimtinas vykdytino pavedimo kiekis, kurį gali sudaryti keli daliniai vykdymai ir kuris paprastai taikomas tik neišliekantiems pavedimams (angl. *non-persistent orders*). Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{DECIMAL-18/17} – kai kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – kai kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte
19	Mažiausias vykdytinas dydis (angl. MES)	Mažiausias vykdymo dydis bet kurio atskiro galimo vykdymo atveju. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{DECIMAL-18/17} – kai kiekis išreikštas vienetų skaičiumi {DECIMAL-18/5} – kai kiekis išreikštas pinigine arba nominaliąja verte
20	MES tik pirmo vykdymo atveju	Nurodoma, ar MES susijęs tik su pirmu vykdymu. Šis laukelis paliekamas tuščias, kai 19 laukelis yra tuščias.	TRUE FALSE
21	Nuoroda „tik pasyvus“	Nurodoma, ar pavedimas pateiktas prekybos vietai su tokia nurodyta savybe/žyma, kad pavedimas iš karto nevykdomas bet kurių priešingų matomų pavedimų atžvilgiu.	TRUE FALSE
22	Savo pavedimų derinimo prevencija (angl. *self-execution prevention*)	Nurodoma, ar pavedimas įvestas su savo pavedimų derinimo prevencijos kriterijais, tam, kad jis nebūtų vykdomas derinant su priešingos pavedimų knygos pusės pavedimu, kurį įvedė tas pats narys arba dalyvis.	TRUE FALSE
23	Data ir laikas (pavedimo pateikimo)	Pavedimo pateikimo prekybos vietai ar kitai investicinei įmonei tiksli data ir laikas.	{DATE_TIME_FORMAT} Skaitmenų po sekundžių skaičius nustatomas pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 priedo 2 lentelę.
24	Data ir laikas (pavedimo gavimo)	Bet kokio su pavedimu susijusio pranešimo, kuris perduotas prekybos vietai ar kitai investicinei įmonei ir iš jų gautas, tiksli data ir laikas.	{DATE_TIME_FORMAT} Skaitmenų po sekundžių skaičius nustatomas pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 priedo 2 lentelę.
25	Sekos numeris	Investicinė įmonė kiekvieną 26 laukelyje nurodytą įvykį identifikuoja naudodama teigiamus sveikuosius skaičius didėjimo tvarka. Kiekvienos rūšies įvykio sekos numeris turi būti unikalus, nuosekliai naudojamas visiems įvykiams, kuriuos laiko žyma pažymėjo investicinė įmonė, ir nekintantis visą dieną, kurią įvyko įvykis.	{INTEGER-50}
26	Naujas pavedimas, pavedimo pakeitimas, pavedimo anuliavimas, pavedimo atmetimas, visiškas ar dalinis įvykdymas	Naujas pavedimas – prekybos vietos operatoriaus gautas naujas pavedimas. Aktyvuotas – pavedimas, kuris tampa vykdytinu arba tam tikrais atvejais nevykdytinu, kai tenkinama iš anksto nustatyta sąlyga.	NEWO – naujas pavedimas TRIG – aktyvuotas

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
		Pakeistas prekybos vietos nario, dalyvio arba kliento – kai prekybos vietos narys, dalyvis ar klientas savo iniciatyva nusprendžia pakeisti bet kurią pavedimo, kurį anksčiau įtraukė į pavedimų knygą, savybę.	REME – pakeistas prekybos vietos nario, dalyvio arba kliento
		Pakeistas rinkos operacijomis (automatiškai) – kai prekybos vietos operatoriaus IT sistemos pakeičia bet kurią pavedimo savybę. Tai apima atvejus, kai susieto pavedimo (angl. *peg order*) arba kintančio nuostolio stabdymo pavedimo (angl. *trailing stop order*) esamos savybės pakeičiamos tam, kad atspindėtų pavedimo vietą pavedimų knygoje.	REMA – pakeistas rinkos operacijomis (automatiškai)
		Pakeistas rinkos operacijomis (įsikišus žmogui) – kai prekybos vietos operatoriaus darbuotojai pakeičia bet kurią pavedimo savybę. Tai apima atvejus, kai prekybos vietos nariui, dalyviui ar klientui iškyla IT problemų ir jis turi skubiai anuliuoti savo pavedimus.	REMH – pakeistas rinkos operacijomis (įsikišus žmogui)
		Statuso pakeitimas prekybos vietos nario, dalyvio ar kliento iniciatyva. Tai apima aktyvavimą ir deaktyvavimą.	CHME – statuso pakeitimas prekybos vietos nario, dalyvio arba kliento iniciatyva
		Statuso pakeitimas dėl rinkos operacijų.	CHMO – statuso pakeitimas dėl rinkos operacijų
		Anuliuota prekybos vietos nario, dalyvio ar kliento iniciatyva.	CAME – anuliuota prekybos vietos nario, dalyvio arba kliento iniciatyva
		Anuliuota rinkos operacijomis. Tai apima apsaugos mechanizmą, numatytą investicinėms įmonėms, vykdančioms algoritminę prekybą rinkos formavimo strategijos tikslu, kaip nustatyta Direktyvos 2014/65/ES 17 ir 48 straipsniuose.	CAMO – anuliuota rinkos operacijomis
		Atmestas pavedimas – prekybos vietos operatoriaus gautas, bet atmestas pavedimas.	REMO – atmestas pavedimas
		Pasibaigusio galiojimo pavedimas – kai pavedimas pašalinamas iš pavedimų knygos, pasibaigus jo galiojimo laikotarpiui.	EXPI – pasibaigusio galiojimo pavedimas
		Įvykdytas iš dalies – kai pavedimas įvykdomas ne visas ir lieka vykdytinas kiekis.	PARF – įvykdytas iš dalies
		Įvykdytas – kai vykdytino kiekio nelieka.	FILL – įvykdytas {ALPHANUM-4} ženklai, dar nenaudoti pagal prekybos vietos klasifikaciją.
27	Skolintų vertybinių popierių pardavimo nuoroda	Skolintų vertybinių popierių pardavimas, kurį atliko investicinė įmonė savo arba kliento vardu, kaip aprašyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 11 straipsnyje.	SSHO – skolintų vertybinių popierių pardavimas netaikant išimčių
		Kai investicinė įmonė vykdo sandorį kliento, kuris parduoda, vardu ir dėdama visas galimas pastangas negali nustatyti, ar tai yra skolintų vertybinių popierių pardavimas, į šį laukelį įrašoma „UNDI“.	SSEX – skolintų vertybinių popierių pardavimas taikant išimtis
		Kai sandoris vykdomas pagal perduotą pavedimą, atitikusį perdavimo sąlygas, nurodytas Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 4 straipsnyje, šį laukelį pildo gaunanti įmonė gaunančios įmonės pranešime, naudodama iš perduodančios įmonės gautą informaciją.	SELL – ne skolintų vertybinių popierių pardavimas UNDI – informacijos nėra

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
		Šis laukelis pildytinas tik tuo atveju, jeigu finansinei priemonei taikomas Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 236/2012 [2], o pardavėjas yra investicinė įmonė arba investicinės įmonės klientas. Šis laukelis skirtas tik įvykdytiems pavedimams.	
28	Leidimo netaikyti reikalavimų nuoroda	Nurodoma, ar sandoris įvykdytas gavus leidimą netaikyti reikalavimų iki sandorio sudarymo pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 4 ir 9 straipsnius. Nuosavo kapitalo finansinių priemonių atveju: RFPT – referencinės kainos sandoris NLIQ – suderėti sandoriai, susiję su likvidžiomis finansinėmis priemonėmis OILQ – suderėti sandoriai, susiję su nelikvidžiomis finansinėmis priemonėmis PRIC – suderėti sandoriai, kuriems taikomos kitos sąlygos nei tos nuosavo kapitalo finansinės priemonės esama rinkos kaina Ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių atveju: SIZE – sandoris, kurio dydis viršija konkretų dydį ILQD – sandoris, susijęs su nelikvidžia finansine priemone Šis laukelis taikomas tik pavedimams, kurie buvo įvykdyti pagal prekybos vietai suteiktą leidimą nesilaikyti reikalavimų.	Įrašyti vieną ar kelias iš šių žymų: RFPT – referencinė kaina NLIQ – suderėti sandoriai (likvidūs) OILQ – suderėti sandoriai (nelikvidūs) PRIC – suderėti sandoriai (sąlygos) SIZE – dydis viršija konkretų dydį ILQD – nelikvidi finansinė priemonė
29	Nukreipimo strategija (angl. *routing strategy*)	Nukreipimo strategija, taikytina pagal prekybos vietos specifikacijas. Šis laukelis paliekamas tuščias, jei jo nereikia.	{ALPHANUM-50}
30	Prekybos vietos sandorio identifikavimo kodas	Raidinis skaitinis kodas, kurį prekybos vieta priskiria sandoriui pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/575 12 straipsnį. Šis laukelis taikomas tik pavedimams, kurie buvo įvykdyti prekybos vietoje.	{ALPHANUM-52}
31	Galiojimo laikotarpis	Galioja iki prekybos dienos pabaigos (angl. *Good-For-Day*) – pavedimas baigia galioti prekybos dienos, kurią jis įrašytas į pavedimų knygą, pabaigoje.	GDAY – galioja iki prekybos dienos pabaigos
		Galioja iki anuliavimo (angl. *Good-Till-Cancelled*) – pavedimų knygoje pavedimas liks aktyvus ir bus vykdytinas, kol bus faktiškai anuliuotas.	GTCA – galioja iki anuliavimo
		Galioja iki nurodyto laiko tą prekybos dieną (angl. *Good-Till-Time*) – pavedimas baigia galioti ne vėliau kaip iš anksto nustatytu laiku einamosios prekybos sesijos metu.	GTHT – galioja iki nurodyto laiko tą prekybos dieną
		Galioja iki nurodytos dienos (angl. *Good-Till-Date*) – pavedimas baigia galioti nurodytos dienos pabaigoje.	GTHD – galioja iki nurodytos dienos
		Galioja iki nurodytos dienos ir laiko (angl. *Good-Till-Specified Date and Time*) – pavedimas baigia galioti nurodytą dieną ir nurodytu laiku.	GTDT – galioja iki nurodytos dienos ir laiko
		Galioja po nurodyto laiko tą prekybos dieną (angl. *Good After Time*) – pavedimas aktyvus tik po iš anksto nustatyto laiko einamosios prekybos sesijos metu.	GAFT – galioja po nurodyto laiko tą prekybos dieną

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
		Galioja po nurodytos dienos (angl. *Good after date*) – pavedimas aktyvus tik nuo iš anksto nustatytos dienos pradžios.	GAFD – galioja po nurodytos dienos
		Galioja po nurodytos dienos ir laiko (angl. *Good after specified date and time*) – pavedimas aktyvus tik nuo iš anksto nustatyto laiko iš anksto nustatytą dieną.	GADT – galioja po nurodytos dienos ir laiko
		Įvykdyti iš karto arba anuliuoti (angl. *Immediate-Or-Cancel)* – pavedimas, kuris vykdomas iš karto jį įrašius į pavedimų knygą (tokį kiekį, kurį galima įvykdyti) ir nelieka pavedimų knygoje dėl likusio neįvykdyto kiekio (jei toks yra).	IOCA – įvykdyti iš karto arba anuliuoti
		Įvykdyti arba anuliuoti (angl. *Fill-Or-Kill*) – pavedimas, kuris vykdomas jį įrašius į pavedimų knygą su sąlyga, kad jį galima visiškai įvykdyti. Jeigu pavedimą galima įvykdyti tik iš dalies, tuomet jis automatiškai atmetamas ir todėl negali būti vykdomas. Kita – bet kokie papildomi specifiniai nurodymai konkretiems verslo modeliams, prekybos platformoms ar sistemoms.	F – įvykdyti arba anuliuoti arba {ALPHANUM-4} ženklai, dar nenaudoti pagal prekybos vietos klasifikaciją.
32	Pavedimų apribojimai	Galioja uždarymo aukciono metu prekybos dienos pabaigoje (angl. *Good For Closing Price Crossing Session*) – kai pavedimas atitinka uždarymo aukciono prekybos sesijos pabaigoje sąlygas.	SESR – galioja uždarymo aukciono metu prekybos dienos pabaigoje
		Galioja aukciono metu (angl. *Valid For Auction*) – pavedimas aktyvus ir vykdytinas tik aukciono etapuose (kuriuos gali iš anksto nustatyti prekybos vietos narys, dalyvis arba klientas, pateikęs pavedimą, pvz., pradiniai ir (arba) baigiamieji aukcionai ir (arba) dienos aukcionas).	VFAR – galioja aukciono metu
		Galioja tik nepertraukiamos prekybos metu (angl. *Valid For Continuous Trading only*) – pavedimas aktyvus tik nepertraukiamos prekybos metu.	VFCR – galioja tik nepertraukiamos prekybos metu
		Kita – bet kokie papildomi specifiniai nurodymai konkretiems verslo modeliams, prekybos platformoms ar sistemoms.	{ALPHANUM-4} ženklai, dar nenaudoti pagal prekybos vietos klasifikaciją. Kai taikomi keli statusai, į šį laukelį įrašomos kelios žymos, kurios atskiriamos kableliais.
33	Galiojimo laikotarpio data ir laikas	Čia nurodoma laiko žyma, kuri rodo laiką, kada pavedimas tampa aktyvus arba galiausiai pašalinamas iš pavedimų knygos. Galioja iki prekybos dienos pabaigos – įtraukimo diena su laiko žyma prieš pat vidurnaktį. Galioja iki nurodyto laiko tą prekybos dieną – įtraukimo diena ir laikas iki to, kuris nurodytas pavedime. Galioja iki nurodytos dienos –nurodyta galiojimo pabaigos diena su laiko žyma prieš pat vidurnaktį. Galioja iki nurodytos dienos ir laiko – nurodyta galiojimo pabaigos diena ir laikas. Galioja po nurodyto laiko tą prekybos dieną – įtraukimo diena ir nurodytas laikas, kada pavedimas tampa aktyvus.	{DATE_TIME_FORMAT} Skaitmenų po sekundžių skaičius nustatomas pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 priedo 2 lentelę.

Nr.	Laukelis/turinys	Aprašymas	Formatas
		Galioja po nurodytos dienos – nurodyta diena su laiko žyma iš karto po vidurnakčio. Galioja po nurodytos dienos ir laiko – automatiškai nurodoma nurodyta diena ir laikas, kada pavedimas tampa aktyvus. Galioja iki anuliavimo – galutinė diena ir galutinis laikas, kai pavedimas automatiškai pašalinamas rinkos operacijomis. Kita – laiko žyma, skirta bet kuriai kitai galiojimo rūšiai.	
34	Jungtinis pavedimas	Nurodoma, ar pavedimas yra jungtinis pagal Deleguotojo reglamento (ES) 2017/575 2 straipsnio 3 dalį.	TRUE FALSE
35	Su pateikiamu pavedimu susijusi papildoma informacija	Visi su pavedimu susiję nurodymai, parametrai, sąlygos ir kiti duomenys, kuriuos: investicinė įmonė perduoda prekybos vietai, visų pirma tie nurodymai, parametrai, sąlygos ir duomenys, kurie prekybos vietai būtini siekiant aiškiai suprasti, kaip jai reikia tvarkyti pavedimą, arba prekybos vieta perduoda investicinei įmonei, visų pirma tie nurodymai, parametrai, sąlygos ir duomenys, kurie investicinei įmonei būtini siekiant gauti aiškios grįžtamosios informacijos apie tai, kaip pavedimas buvo tvarkomas.	Laisvo pobūdžio tekstas

([1]) 2016 m. birželio 8 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/575, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų papildoma techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su sandorių vykdymo kokybės duomenimis, kuriuos turi skelbti vykdymo vietos (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 152).

([2]) 2012 m. kovo 14 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 236/2012 dėl skolintų vertybinių popierių pardavimo ir tam tikrų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių aspektų (OL L 86, 2012 3 24, p. 1).