

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/589**(2016. gada 19. jūlijs),****ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kas precizē algoritmiskajā tirdzniecībā iesaistīto ieguldījumu brokeru sabiedrību organizatoriskās prasības****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Direktīvu 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/EK un Direktīvu 2011/61/ES ⁽¹⁾ un jo īpaši tās 17. panta 7. punkta a) un b) apakšpunktu,

tā kā:

- (1) Sistēmām un riska kontrolpasākumiem, ko izmanto algoritmiskajā tirdzniecībā iesaistītās ieguldījumu brokeru sabiedrības, kuras sniedz tiešu elektronisku piekļuvi vai darbojas kā vispārēji tūrvērtes dalībnieki, vajadzētu būt efektīviem, noturīgiem un pietiekami jaudīgiem, ņemot vērā minēto ieguldījumu brokeru sabiedrību darbības modeļa būtību, apjomu un sarežģītību.
- (2) Šajā nolūkā ieguldījumu brokeru sabiedrībai būtu jānovērš visi riski, kas var ietekmēt algoritmiskas tirdzniecības sistēmas pamatelementus, tostarp jānovērš riski saistībā ar minētās sabiedrības tirdzniecības darbību veikšanai izmantoto aparāturu, programmatūru un saistītajām sakaru līnijām. Lai nodrošinātu vienādus algoritmiskās tirdzniecības nosacījumus neatkarīgi no tirdzniecības formas, šī regula būtu jāattiecina uz visiem ieguldījumu brokeru sabiedrības izmantoto izpildes sistēmu vai rīkojumu pārvaldības sistēmu veidiem.
- (3) Ieguldījumu brokeru sabiedrībai savas vispārīgās pārvaldības un lēmumu pieņemšanas sistēmas ietvaros vajadzētu būt skaidram un formalizētam pārvaldības mehānismam, tostarp skaidrai pārskatatbildības hierarhijai, efektīvām informācijas paziņošanas procedūrām un nodalītiem uzdevumiem un atbildībai. Mehānismam būtu jāierobežo atkarība no tikai vienas personas vai vienības.
- (4) Būtu jāveic atbilstības testēšana, lai pārliecinātos, ka ieguldījumu brokeru sabiedrības tirdzniecības sistēmas pareizi komunicē un mijiedarbojas ar tirdzniecības vietas vai tiešas tirgus piekļuves (TTP) nodrošinātāja tirdzniecības sistēmām un ka tirgus dati tiek apstrādāti pareizi.
- (5) Ieguldījumu lēmumu algoritmi pieņem automatizētus tirdzniecības lēmumus, nosakot, kurš finanšu instruments būtu jāpērk un kurš – jāpārdod. Rīkojumu izpildes algoritmi optimizē rīkojumu izpildes procesu, automātiski ģenerējot un iesniedzot rīkojumus vai kotācijas vienai vai vairākām tirdzniecības vietām tad, kad pieņemts ieguldījumu lēmums. Tirdzniecības algoritmi, kas ir ieguldījumu lēmumu algoritmi, būtu jānošķir no rīkojumu izpildes algoritmiem, ņemot vērā to iespējamo ietekmi uz taisnīgu un pienācīgu tirgus vispārējo darbību.
- (6) Prasības attiecībā uz tirdzniecības algoritmu testēšanu būtu jābalsta uz iespējamo ietekmi, ko minētie algoritmi varētu radīt uz taisnīgu un pienācīgu tirgus vispārējo darbību. Šajā sakarā no testēšanas prasībām būtu jāizslēdz tikai tīri ieguldījumu lēmumu algoritmi, kas ģenerē rīkojumus, kuri ir izpildāmi tikai ar neautomātiskiem līdzekļiem un ar cilvēka iejaukšanos.
- (7) Sākot izmantot tirdzniecības algoritmus, ieguldījumu brokeru sabiedrībai būtu jānodrošina kontrolēta tirdzniecības algoritmu ieviešana neatkarīgi no tā, vai šie algoritmi ir jauni vai iepriekš ir tikuši veiksmīgi ieviesti citā tirdzniecības vietā, un tā, vai struktūra ir tikusi būtiski grozīta. Ar tirdzniecības algoritmu kontrolētu

⁽¹⁾ OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp.

ieviešanu būtu jānodrošina, ka tirdzniecības algoritmi darba vidē sniedz gaidītos rezultātus. Tāpēc ieguldījumu brokeru sabiedrībai būtu jānosaka piesardzīgi ierobežojumi attiecībā uz tirgoto finanšu instrumentu skaitu, rīkojumu cenu, vērtību un skaitu, stratēģijas pozīcijām un iesaistīto tirgu skaitu un intensīvāk jāuzrauga algoritmu darbība.

- (8) Ieguldījumu brokeru sabiedrības atbilstība īpašajām organizatoriskajām prasībām būtu jānosaka saskaņā ar pašnovērtējumu, kas ietver novērtējumu par atbilstību kritērijiem, kuri norādīti šīs regulas I pielikumā. Turklāt pašnovērtējumā būtu jāiekļauj visi pārējie apstākļi, kas varētu ietekmēt minēto ieguldījumu brokeru sabiedrību. Pašnovērtējums būtu jāveic regulāri un tam vajadzētu ļaut ieguldījumu brokeru sabiedrībai gūt pilnīgu izpratni par tās izmantotajām tirdzniecības sistēmām un tirdzniecības algoritmiem, kā arī par riskiem, kas izriet no algoritmiskās tirdzniecības, neatkarīgi no tā, vai ieguldījumu brokeru sabiedrība minētās sistēmas un algoritmus ir izstrādājusi pati, iegādājusies no trešās personas vai projektējusi vai izstrādājusi ciešā sadarbībā ar klientu vai trešo personu.
- (9) Ieguldījumu brokeru sabiedrībai vajadzības gadījumā vajadzētu būt spējīgai atsaukt visus vai dažus savus rīkojumus ("atcelšanas funkcionalitāte"). Lai šāda atsaukšana būtu efektīva, ieguldījumu brokeru sabiedrībai vienmēr vajadzētu būt iespējai uzzināt, kuri tirdzniecības algoritmi, tirgotāji vai klienti ir atbildīgi par rīkojumu.
- (10) Ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas veic algoritmisko tirdzniecību, būtu jāuzrauga, ka tās tirdzniecības sistēmas nevar izmantot nolūkā, kas neatbilst Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 596/2014 ⁽¹⁾ noteikumiem vai tās tirdzniecības vietas noteikumiem, ar ko sabiedrība ir savienota. Saskaņā ar minēto regulu par aizdomīgiem darījumiem vai rīkojumiem būtu jāziņo kompetentajām iestādēm.
- (11) Dažāda veida riski būtu jānovērš ar dažāda veida kontrolpasākumiem. Pirms rīkojuma iesniegšanas tirdzniecības vietai būtu jāveic pirmstirdzniecības kontrolpasākumi. Ieguldījumu brokeru sabiedrībām būtu arī jāuzrauga sava tirdzniecības darbība un jāievieš reāllaika brīdinājumi, ar ko konstatēt nepienācīgas tirdzniecības pazīmes vai pirmstirdzniecības ierobežojumu pārkāpumus. Būtu jāievieš pēctirdzniecības kontrolpasākumi, lai ar pēctirdzniecības saskaņošanas palīdzību uzraudzītu ieguldījumu brokeru sabiedrību tirgus riskus un kredītriskus. Turklāt iespējama tirgus ļaunprātīga izmantošana un tirdzniecības vietas noteikumu pārkāpumi būtu jānovērš, izmantojot īpašas uzraudzības sistēmas, kas vēlākais nākamajā dienā ģenerē brīdinājumu un kas ir kalibrētas tādā veidā, lai līdz minimumam samazinātu kļūdainu pozitīvo un negatīvo brīdinājumu skaitu.
- (12) Brīdinājumi pēc reāllaikā veiktas uzraudzības būtu jāģenerē nekavējoties, tiklīdz tas ir tehniski iespējams. Visas darbības pēc šādas uzraudzības būtu jāveic, tiklīdz tas ir iespējams, ņemot vērā saprātīgu efektivitātes līmeni un attiecīgo personu un sistēmu izmaksas.
- (13) Ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas sniedz tiešu elektronisku piekļuvi (TEP sniedzējs), vajadzētu palikt atbildīgai par veikto tirdzniecību, nodrošinot, ka tās TEP klienti izmanto sabiedrības tirdzniecības kodu. Tāpēc TEP sniedzējam būtu jānosaka politika un procedūras, ar ko nodrošināt, ka tā TEP klientu tirdzniecība atbilst prasībām, kuras piemērojamas šim pakalpojumu sniedzējam. Šādai atbildībai vajadzētu būt galvenajam faktoram, lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības kontrolpasākumus un novērtētu potenciālo TEP klientu piemērotību. Tādēļ TEP sniedzējam vajadzētu būt pietiekamām zināšanām par TEP klientu nodomiem, spējām, finanšu resursiem un uzticamību, tostarp, ja tā ir publiski pieejama, informācijai par potenciālo TEP klientu disciplināro vēsturi ar kompetentajām iestādēm un tirdzniecības vietām.
- (14) TEP sniedzējam būtu jāatbilst šīs regulas noteikumiem pat tad, ja tas nav iesaistīts algoritmiskajā tirdzniecībā, jo tā klienti var izmantot TEP, lai iesaistītos algoritmiskajā tirdzniecībā.
- (15) TEP potenciālo klientu uzticamības pārbaude būtu jāpielāgo riskiem, ko rada to sagaidāmo tirdzniecības darbību būtība, apjoms un sarežģītība, un sniegtajai tiešajai elektroniskajai piekļuvei. Konkrēti, būtu jānovērtē sagaidāmais tirdzniecības līmenis un rīkojumu apjoms, kā arī attiecīgajām tirdzniecības vietām piedāvātā savienojuma veids.
- (16) Būtu jānosaka saturs un formāts veidlapām, ko ieguldījumu brokeru sabiedrība, kura izmanto augstas intensitātes tirdzniecības metodi, lieto, lai kompetentajām iestādēm iesniegtu datus par saviem izvietotajiem rīkojumiem, un jānosaka minēto datu uzglabāšanas ilgums.

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 16. aprīļa Regula (ES) Nr. 596/2014 par tirgus ļaunprātīgu izmantošanu (tirgus ļaunprātīgas izmantošanas regula) un ar ko atceļ Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2003/6/EK un Komisijas Direktīvas 2003/124/EK, 2003/125/EK un 2004/72/EK (OV L 173, 12.6.2014., 1. lpp.).

- (17) Lai nodrošinātu atbilstību vispārējai prasībai ieguldījumu brokeru sabiedrībai glabāt datus par rīkojumiem, nepieciešamie datu uzglabāšanas periodi ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas izmanto augstas intensitātes algoritmiskās tirdzniecības metodes, būtu jāsakrāj ar tiem, kas noteikti Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 600/2014 ⁽¹⁾ 25. panta 1. punktā.
- (18) Konsekvences labad un lai nodrošinātu finanšu tirgu netraucētu darbību, ir nepieciešams noteikt, ka šajā regulā paredzētie noteikumi un saistītie valsts noteikumi, ar kuriem transponē Direktīvu 2014/65/ES, tiek piemēroti no viena un tā paša datuma.
- (19) Šīs regulas pamatā ir regulatīvo tehnisko standartu projekts, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).
- (20) EVTI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu izveidotās Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu ⁽²⁾.

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

I NODAĻA

VISPĀRĪGAS ORGANIZATORISKĀS PRASĪBAS

1. pants

Vispārīgas organizatoriskās prasības

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

Ieguldījumu brokeru sabiedrība vispārīgā pārvaldības un lēmumu pieņemšanas procesa ietvaros, izmantojot skaidru un formalizētu pārvaldības mehānismu, izveido un uzrauga savas tirdzniecības sistēmas un algoritmus, ņemot vērā savas darbīdarbības būtību, apjomu un sarežģītību un nosakot:

- a) skaidru pārskatatbildības hierarhiju, tostarp procedūras tirdzniecības algoritmu izstrādes, ieviešanas un turpmākas atjaunināšanas apstiprināšanai un tirdzniecības algoritmu uzraudzības laikā identificēto problēmu atrisināšanai;
- b) efektīvas procedūras informācijas paziņošanai ieguldījumu brokeru sabiedrības iekšienē, lai norādījumus varētu iegūt un īstenot efektīvi un savlaicīgi;
- c) tirdzniecības struktūrvienību uzdevumu un pienākumu nodalīšanu no atbalsta funkcijām, tostarp riska kontroles un atbilstības funkcijām, lai nodrošinātu, ka neatļautu tirdzniecības darbību nav iespējams noslēpt.

2. pants

Atbilstības funkcijas loma

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka atbilstības jomā nodarbinātajiem darbiniekiem ir vismaz vispārēja izpratne par to, kā darbojas ieguldījumu brokeru sabiedrības algoritmiskās tirdzniecības sistēmas un tirdzniecības algoritmi. Atbilstības jomā nodarbinātie darbinieki uztur pastāvīgu saziņu ar tām personām attiecīgajā sabiedrībā, kam ir detalizētas zināšanas par sabiedrības algoritmiskās tirdzniecības sistēmām un algoritmiem.

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

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina arī to, ka atbilstības jomā nodarbinātajiem darbiniekiem jebkurā laikā ir iespēja sazināties ar tādu personu vai personām attiecīgajā ieguldījumu brokeru sabiedrībā, kam ir piekļuve 12. pantā minētajai funkcionalitātei ("atcelšanas funkcionalitāte"), vai ka tiem ir tieša piekļuve minētajai atcelšanas funkcionalitātei un tām personām, kas ir atbildīgas par katru tirdzniecības sistēmu vai algoritmu.

3. Ja sabiedrības atbilstības funkcija vai tās elementi tiek kā ārpalpojums uzticēti trešai personai, ieguldījumu brokeru sabiedrība trešai personai sniedz tādu pašu piekļuvi informācijai, kādu tā sniegtu saviem darbiniekiem. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka, izmantojot šādu ārēju atbilstības funkciju:

- a) tiek garantēts datu privātums;
- b) atbilstības funkciju var revidēt iekšēji un ārēji revidenti vai kompetentā iestāde.

3. pants

Darbinieki

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodarbina pietiekamu tādu darbinieku skaitu, kam ir nepieciešamās prasmes, lai pārvaldītu algoritmiskās tirdzniecības sistēmas un tirdzniecības algoritmus, un kam ir pietiekamas tehniskās zināšanas par:

- a) attiecīgajām tirdzniecības sistēmām un algoritmiem;
- b) šādu sistēmu un algoritmu uzraudzību un testēšanu;
- c) tirdzniecības stratēģijām, ko ieguldījumu brokeru sabiedrība izmanto savās algoritmiskās tirdzniecības sistēmās un tirdzniecības algoritmos;
- d) ieguldījumu brokeru sabiedrības juridiskajām saistībām.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība precīzē nepieciešamās 1. punktā minētās prasmes. Šā panta 1. punktā minētajiem darbiniekiem nepieciešamās prasmes piemīt darbā pieņemšanas laikā vai tie šīs prasmes apmācības ceļā iegūst pēc pieņemšanas darbā. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka minēto darbinieku prasmes pastāvīgi tiek atjauninātas apmācības ceļā, un regulāri izvērtē viņu prasmes.

3. Šā panta 2. punktā minētā darbinieku apmācība ir pielāgota darbinieku pieredzei un atbildībai, ņemot vērā ieguldījumu brokeru sabiedrības darbību būtību, apjomu un sarežģītību. Konkrēti, rīkojumu iesniegšanā iesaistītajiem darbiniekiem nodrošina apmācību par rīkojumu iesniegšanas sistēmām un tirgus ļaunprātīgu izmantošanu.

4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka par algoritmiskās tirdzniecības riska un atbilstības funkcijām atbildīgajiem darbiniekiem ir:

- a) pietiekamas zināšanas par algoritmisko tirdzniecību un stratēģijām;
- b) pietiekamas prasmes, kā reaģēt uz automātisko brīdinājumu sniegto informāciju;
- c) pietiekamas pilnvaras apstrīdēt par algoritmisko tirdzniecību atbildīgo darbinieku darbības, ja šāda tirdzniecība rada nepienācīgus tirdzniecības apstākļus vai aizdomas par tirgus ļaunprātīgu izmantošanu.

4. pants

IT ārpalpojumi un iepirkums

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ja ieguldījumu brokeru sabiedrība tirdzniecības darbībām izmantotu programmatūru vai iekārtas iegūst no ārpalpojumu sniedzēja vai iepērk, tā saglabā pilnu atbildību par savu pienākumu izpildi saskaņā ar šo regulu.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrībai ir pietiekamas zināšanas un nepieciešamā dokumentācija, lai nodrošinātu algoritmiskajā tirdzniecībā izmantoto iepirkto vai no ārpalpojumu sniedzēja iegūto iekārtu vai programmatūras efektīvu atbilstību 1. punktam.

II NODAĻA

TIRDZNIECĪBAS SISTĒMU NOTURĪBA

I IEDAĻA

Tirdzniecības algoritmu sistēmu un stratēģiju testēšana un ieviešana

5. pants

Vispārīgā metodoloģija

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Pirms algoritmiskas tirdzniecības sistēmas, tirdzniecības algoritma vai algoritmiskas tirdzniecības stratēģijas ieviešanas vai būtiskas atjaunināšanas ieguldījumu brokeru sabiedrība izveido skaidri noteiktas metodoloģijas šādu sistēmu, algoritmu vai stratēģiju izstrādāšanai un testēšanai.
2. Algoritmiskas tirdzniecības sistēmas, tirdzniecības algoritma vai algoritmiskas tirdzniecības stratēģijas ieviešanu vai būtisku atjaunināšanu atļauj ieguldījumu brokeru sabiedrības augstākās vadības norīkota persona.
3. Šā panta 1. punktā minētās metodoloģijas attiecas uz algoritmiskās tirdzniecības sistēmas, tirdzniecības algoritma vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģijas izstrādi, sniegumu, datu uzglabāšanu un apstiprināšanu. Tās nosaka arī pienākumu sadali, pietiekamu līdzekļu piešķiršanu, kā arī procedūras norādījumu pieprasīšanai ieguldījumu brokeru sabiedrībā.
4. Šā panta 1. punktā minētās metodoloģijas nodrošina, ka algoritmiskās tirdzniecības sistēma, tirdzniecības algoritms vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģija:
 - a) neuzvedas neparedzētā veidā;
 - b) atbilst ieguldījumu brokeru sabiedrības pienākumiem saskaņā ar šo regulu;
 - c) atbilst to tirdzniecības vietu noteikumiem un sistēmām, kurām piekļūst ieguldījumu brokeru sabiedrība;
 - d) neveicina nepienācīgus tirdzniecības apstākļus, turpina efektīvi darboties tirgus spriedzes apstākļos un, ja nepieciešams, šādos apstākļos ļauj izslēgt algoritmiskās tirdzniecības sistēmu vai tirdzniecības algoritmu.
5. Ieguldījumu brokeru sabiedrība testēšanas metodoloģijas pielāgo tirdzniecības vietām un tirgiem, kuros tiks ieviests tirdzniecības algoritms. Ieguldījumu brokeru sabiedrība veic papildu testus, ja notiek būtiskas izmaiņas algoritmiskās tirdzniecības sistēmā vai piekļuvē tirdzniecības vietai, kurā paredzēts izmantot algoritmiskās tirdzniecības sistēmu, tirdzniecības algoritmu vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģiju.
6. Šā panta 2. līdz 5. punktu piemēro tikai tirdzniecības algoritmiem, kas noved pie rīkojumu izpildes.
7. Ieguldījumu brokeru sabiedrība datus par visām būtiskajām izmaiņām, kas ieviestas algoritmiskajā tirdzniecībā izmantotajā programmatūrā, saglabā, lai varētu noteikt:
 - a) kad ir izdarīta izmaiņa;
 - b) personu, kas izdarījusi izmaiņu;
 - c) personu, kas apstiprinājusi izmaiņu;
 - d) izmaiņas būtību.

6. pants

Atbilstības testēšana

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība testē savas algoritmiskās tirdzniecības sistēmas un tirdzniecības algoritmu atbilstību:
 - a) tirdzniecības vietas sistēmai jebkurā no šādiem gadījumiem:
 - i) piekļūstot minētajai tirdzniecības vietai dalībnieka statusā;
 - ii) pirmo reizi savienojoties ar minēto tirdzniecības vietu, izmantojot sponsorētās piekļuves režīmu;

- iii) minētās tirdzniecības vietas sistēmu būtiskas izmaiņas gadījumā;
 - iv) pirms tiek ieviesta vai būtiski atjaunināta minētās ieguldījumu brokeru sabiedrības algoritmiskās tirdzniecības sistēma, tirdzniecības algoritms vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģija;
- b) tiešas tirgus piekļuves sniedzēja sistēmai jebkurā no šādiem gadījumiem:
- i) pirmo reizi piekļūstot minētajai tirdzniecības vietai, izmantojot tiešas tirgus piekļuves režīmu;
 - ii) tādas būtiskas izmaiņas gadījumā, kas ietekmē minētā piekļuves sniedzēja tiešas tirgus piekļuves funkcionalitāti;
 - iii) pirms tiek ieviesta vai būtiski atjaunināta minētās ieguldījumu brokeru sabiedrības algoritmiskās tirdzniecības sistēma, tirdzniecības algoritms vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģija.
2. Ar atbilstības testiem pārbauda, vai algoritmiskās tirdzniecības sistēmas vai tirdzniecības algoritma pamatelementi darbojas pareizi un saskaņā ar tirdzniecības vietas vai tiešas tirgus piekļuves sniedzēja prasībām. Šajā nolūkā ar testēšanu pārliecinās, ka algoritmiskā tirdzniecības sistēma vai tirdzniecības algoritms:
- a) ar tirdzniecības vietas savietošanas loģiku mijiedarbojas, kā paredzēts;
 - b) pienācīgi apstrādā no tirdzniecības vietas lejupielādētās datu plūsmas.

7. pants

Testēšanas vide

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka testēšana par atbilstību 5. panta 4. punkta a), b) un d) apakšpunktā noteiktajiem kritērijiem tiek veikta vidē, kas ir nodalīta no darba vides un ko izmanto tieši algoritmiskās tirdzniecības sistēmu un tirdzniecības algoritmu testēšanai un izstrādei.

Pirmās daļas nolūkos darba vide ir vide, kurā algoritmiskās tirdzniecības sistēmas faktiski darbojas un kura ietver tirgotāju izmantoto programmatūru un aparatūru, rīkojumu maršrutēšanu uz tirdzniecības vietām, tirgus datus, atkarīgās datubāzes, riska vadības sistēmas, datu vākšanu, analizēšanas sistēmas un pēctirdzniecības apstrādes sistēmas.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība var izpildīt 1. punktā minētās testēšanas prasības, izmantojot savu pašu testēšanas vidi vai tirdzniecības vietas, TEP sniedzēja vai pārdevēja nodrošinātu testēšanas vidi.

3. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ir pilnībā atbildīga par tās algoritmiskās tirdzniecības sistēmu, tirdzniecības algoritmu vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģiju testēšanu un par nepieciešamo izmaiņu veikšanu tajos.

8. pants

Kontrolēta algoritmu ieviešana

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

Pirms tirdzniecības algoritma ieviešanas ieguldījumu brokeru sabiedrība nosaka iepriekš noteiktus ierobežojumus:

- a) tirgoto finanšu instrumentu skaitam;
- b) rīkojumu cenai, vērtībai un skaitam;
- c) stratēģijas pozīcijām; un
- d) to tirdzniecības vietu skaitam, kam tiek nosūtīti rīkojumi.

2. IEDAĻA

Pārciešanas pārvaldība

9. pants

Ikgadējs pašnovērtējums un validācija

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ik gadu veic pašnovērtējuma un validācijas procesu un, pamatojoties uz šo procesu, sagatavo validācijas ziņojumu. Šā procesa gaitā ieguldījumu brokeru sabiedrība pārskata, novērtē un validē:

- a) savas algoritmiskās tirdzniecības sistēmas, tirdzniecības algoritmus un algoritmiskās tirdzniecības stratēģijas;
- b) savu pārvaldības, pārskatatbildības un apstiprināšanas satvaru;
- c) savu darbības nepārtrauktības mehānismu;
- d) savu vispārējo atbilstību Direktīvas 2014/65/ES 17. pantam, ņemot vērā darījumdarbības būtību, apjomu un sarežģītību.

Pašnovērtējums ietver arī vismaz analīzi par atbilstību šīs regulas I pielikumā izklāstītajiem kritērijiem.

2. Validācijas ziņojumu sagatavo ieguldījumu brokeru sabiedrības riska pārvaldības funkcija, kas minēta Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/565 (⁽¹⁾) 23. panta 2. punktā, un šajā nolūkā iesaista darbiniekus ar nepieciešamajām tehniskajām zināšanām. Riska pārvaldības funkcija informē atbilstības funkciju par visiem trūkumiem, kas konstatēti validācijas ziņojumā.

3. Validācijas ziņojumu revidē sabiedrības iekšējās revīzijas funkcija, ja tāda ir, un apstiprina ieguldījumu brokeru sabiedrības augstākā vadība.

4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība novērš jebkākus trūkumus, kas konstatēti validācijas ziņojumā.

5. Ja ieguldījumu brokeru sabiedrība nav izveidojusi Deleģētās regulas (ES) 2017/565 23. panta 2. punktā minēto riska pārvaldības funkciju, šajā regulā riska pārvaldības funkcijai noteiktās prasības piemēro citai funkcijai, ko ieguldījumu brokeru sabiedrība izveidojusi saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/565 23. panta 2. punktu.

10. pants

Spriedzes testēšana

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

Šīs regulas 9. pantā minētā ikgadējā pašnovērtējuma ietvaros ieguldījumu brokeru sabiedrība pārbauda, vai algoritmiskās tirdzniecības sistēmas un 12. līdz 18. pantā minētās procedūras un kontrolpasākumi var izturēt lielāku rīkojumu plūsmu vai spiedi tirgū. Ieguldījumu brokeru sabiedrība izstrādā šādus testus, ņemot vērā tās tirdzniecības darbības un tirdzniecības sistēmas. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka testi tiek veikti tā, ka tie neietekmē darba vidi. Minētajos testos ietilpst:

- a) liela apjoma ziņojumapmaiņas testu veikšana ar visaugstāko ieguldījumu brokeru sabiedrības saņemto un nosūtīto ziņojumu skaitu pēdējo sešu mēnešu laikā, reizinātu ar divi;
- b) liela tirdzniecības apjoma testu veikšana ar visaugstāko ieguldījumu brokeru sabiedrības sasniegto tirdzniecības līmeni pēdējo sešu mēnešu laikā, reizinātu ar divi.

(⁽¹⁾) Komisijas 2016. gada 25. aprīļa Deleģētā regula (ES) 2017/565, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību organizatoriskām prasībām un darbības nosacījumiem un jēdzienu definīcijām minētās direktīvas mērķiem (skatīt šā Oficiālā Vēstneša 1. lpp.).

11. pants

Būtisku izmaiņu pārvaldība

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka tādas būtiskas ierosinātas izmaiņas darba vidē, kas attiecas uz algoritmisko tirdzniecību, iepriekš pārskata ieguldījumu brokeru sabiedrības augstākās vadības iecelta persona. Pārskatīšanas dziļums ir proporcionāls ierosināto izmaiņu apjomam.
2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība izveido procedūras, lai nodrošinātu, ka visas izmaiņas tās sistēmu funkcionalitātē dara zināmas par tirdzniecības algoritmu atbildīgajiem tirgotājiem, atbilstības funkcijai un riska pārvaldības funkcijai.

3. IEDAĻA

Noturības nodrošināšanas līdzekļi

12. pants

Atcelšanas funkcionalitāte

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība spēj ārkārtas pasākuma ietvaros nekavējoties atcelt kādu vai visus neizpildītos rīkojumus, kas iesniegti kādā vai visās tirdzniecības vietās, ar kurām ieguldījumu brokeru sabiedrība ir savienota ("atcelšanas funkcionalitāte").
2. Šā panta 1. punkta nolūkos neizpildītie rīkojumi ietver rīkojumus no atsevišķiem tirgotājiem, tirdzniecības struktūrvienībām vai attiecīgā gadījumā no klientiem.
3. Šā panta 1. un 2. punkta nolūkos ieguldījumu brokeru sabiedrība spēj identificēt, kurš tirdzniecības algoritms un tirgotājs, tirdzniecības struktūrvienība vai attiecīgā gadījumā klients ir atbildīgs par katru rīkojumu, kas nosūtīts tirdzniecības vietai.

13. pants

Automatizēta uzraudzības sistēma, ar ko konstatēt tirgus manipulācijas

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība uzrauga visas tirdzniecības darbības, kas notiek, izmantojot tās tirdzniecības sistēmas, tostarp tās klientu tirdzniecības darbības, lai konstatētu iespējamu tirgus manipulāciju pazīmes, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 596/2014 12. pantā.
2. Šā panta 1. punkta nolūkos ieguldījumu brokeru sabiedrība izveido un uztur automatizētu uzraudzības sistēmu, kas efektīvi uzrauga rīkojumus un darījumus, ģenerē brīdinājumus un ziņojumus un attiecīgā gadījumā izmanto vizualizācijas rīkus.
3. Automatizētā uzraudzības sistēma aptver visas tirdzniecības darbības, ko veic ieguldījumu brokeru sabiedrība, un visus rīkojumus, ko tā iesniedz. Tā ir projektēta, ņemot vērā ieguldījumu brokeru sabiedrības tirdzniecības darbību būtību, apjomu un sarežģītību, piemēram, tirgots instrumentu veidu un apjomu, rīkojumu plūsmas apmēru un sarežģītību un tirgus, kam piekļūts.
4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība visas tās norādes par aizdomīgām tirdzniecības darbībām, kuras izmeklēšanas posmā ģenerējusi tās automatizētā uzraudzības sistēma, salīdzina ar citām atbilstīgām šīs sabiedrības tirdzniecības darbībām.
5. Ieguldījumu brokeru sabiedrības automatizētā uzraudzības sistēma ir pielāgojama izmaiņām regulatīvajos pienākumos un ieguldījumu brokeru sabiedrības darbībās, tostarp izmaiņām tās tirdzniecības stratēģijā un klientu tirdzniecības stratēģijā.
6. Ieguldījumu brokeru sabiedrība vismaz reizi gadā pārskata savu automatizēto uzraudzības sistēmu, lai novērtētu, vai šī sistēma un tās izmantotie parametri un filtri joprojām atbilst ieguldījumu brokeru sabiedrības regulatīvajiem pienākumiem un tirdzniecības darbībai, tostarp tās spēju mazināt kļūdaini negatīvu un kļūdaini pozitīvu uzraudzības brīdinājumu ģenerēšanu.

7. Izmantojot pietiekami detalizētu laika granularitātes līmeni, ieguldījumu brokeru sabiedrības automatizētā uzraudzības sistēma spēj lasīt, reproducēt un analizēt rīkojuma un darījuma datus *ex post*, ar pietiekamu jaudu, lai attiecīgā gadījumā spētu darboties automatizētā zema latentuma tirdzniecības vidē. Tā spēj arī ģenerēt funkcionālus brīdinājumus nākamās tirdzniecības dienas sākumā vai, ja ir iesaistīts manuāls process, nākamās tirdzniecības dienas beigās. Ieguldījumu brokeru sabiedrības uzraudzības sistēmai ir atbilstoša dokumentācija un procedūras, lai efektīvi reaģētu uz tās ģenerētajiem brīdinājumiem.

8. Personāls, kas ir atbildīgs par ieguldījumu brokeru sabiedrības tirdzniecības darbību uzraudzību 1. līdz 7. punkta nolūkos atbilstības funkcijai ziņo par ikvienu tirdzniecības darbību, kas varētu neatbilst ieguldījumu brokeru sabiedrības politikai un procedūrām vai tās regulatīvajiem pienākumiem. Atbilstības funkcija novērtē minēto informāciju un attiecīgi rīkojas. Šāda rīcība ietver ziņošanu tirdzniecības vietai vai ziņojuma iesniegšanu par aizdomīgu darījumu vai rīkojumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 596/2014 16. pantu.

9. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka tās tirdzniecības un uzskaites dati ir precīzi, pilnīgi un konsekventi, pēc iespējas drīz savu elektroniskās tirdzniecības reģistru saskaņojot ar tirdzniecības vietu, brokeru, tīrvērtes dalībnieku, centrālo darījumu partneru, datu sniedzēju vai citu attiecīgo darījumu partneru sniegtajiem datiem, attiecīgā gadījumā ņemot vērā darījumdarbības būtību, apjomu un sarežģītību.

14. pants

Darījumdarbības nepārtrauktības mehānismi

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrībai attiecībā uz tās algoritmiskās tirdzniecības sistēmām ir darījumdarbības nepārtrauktības mehānismi, kas ir piemēroti darījumdarbības būtībai, apjomam un sarežģītībai. Šie mehānismi ir dokumentēti pastāvīgā informācijas nesējā.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrības darījumdarbības nepārtrauktības mehānismi efektīvi atrisina traucējumus radošus incidentus un vajadzības gadījumā nodrošina savlaicīgu algoritmiskās tirdzniecības atsākšanu. Minētie mehānismi ir pielāgoti katras piekļuves tirdzniecības vietas tirdzniecības sistēmām un ietver:

- a) pārvaldības sistēmu darījumdarbības nepārtrauktības mehānismu izstrādei un ieviešanai;
- b) virkni iespējamo nelabvēlīgo scenāriju, kas attiecas uz algoritmiskās tirdzniecības sistēmu darbību, tostarp sistēmu, darbinieku, darba vietas, ārējo piegādātāju vai datu centru nepieejamību vai kritiski svarīgu datu un dokumentu pazaudēšanu vai izmaiņšanu;
- c) procedūras tirdzniecības sistēmas pārvietošanai uz rezerves objektu un tirdzniecības sistēmas darbināšanu no minētā objekta, ja šāda objekta pastāvēšana ir piemērota ieguldījumu brokeru sabiedrības algoritmiskās tirdzniecības darbības būtībai, apjomam un sarežģītībai;
- d) personāla mācības par darījumdarbības nepārtrauktības mehānismiem;
- e) izmantošanas politiku attiecībā uz 12. pantā minēto funkcionalitāti;
- f) mehānismus attiecīgā tirdzniecības algoritma vai tirdzniecības sistēmas slēgšanai, ja tas nepieciešams;
- g) alternatīvus mehānismus, ar ko ieguldījumu brokeru sabiedrībai pārvaldīt neizpildītos rīkojumus un pozīcijas.

3. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka tās tirdzniecības algoritmu vai tirdzniecības sistēmu var slēgt saskaņā ar darījumdarbības nepārtrauktības mehānismiem, neradot neatbilstīgus tirdzniecības apstākļus.

4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība katru gadu pārskata un testē savus darījumdarbības nepārtrauktības mehānismus un maina mehānismus, ņemot vērā minēto pārskatīšanu.

15. pants

Pirmstirdzniecības kontrolpasākumi rīkojumu reģistrēšanas brīdī

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem rīkojumu reģistrēšanas brīdī veic šādus pirmstirdzniecības kontrolpasākumus:
 - a) cenu atšķirības (*collars*), kas automātiski bloķē vai atceļ rīkojumus, kuri neatbilst iepriekš noteiktiem cenu parametriem, nošķirot dažādus finanšu instrumentus, gan izskatot rīkojumu pēc rīkojuma, gan vērtējot konkrētā laika posmā;
 - b) maksimālās rīkojumu vērtības, kas neļauj rīkojumu reģistrā ievadīt rīkojumus ar nepieredzēti lielu vērtību;
 - c) maksimālie rīkojumu apjomi, kas neļauj rīkojumu reģistrā ievadīt rīkojumus ar nepieredzēti lielu apjomu;
 - d) maksimālais ziņojumu limits, kas nepieļauj uz rīkojumu reģistriem nosūtīt pārmērīgu ziņojumu skaitu par rīkojuma iesniegšanu, grozīšanu vai atcelšanu.
2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība visus tirdzniecības vietai nosūtītos rīkojumus nekavējoties iekļauj 1. punktā minēto pirmstirdzniecības limitu aprēķinā.
3. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ievieš automatizētus izpildes ierobežošanas mehānismus (*throttles*), ar ko kontrolē algoritmiskās tirdzniecības stratēģijas piemērošanas reižu skaitu. Pēc iepriekš noteikta atkārtotas izpildes reižu skaita tirdzniecības sistēma tiek automātiski atspējota līdz brīdim, kad to atkal iespējo norīkots darbinieks.
4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nosaka tirgus risku un kredītrisku limitus, kuru pamatā ir kapitāla bāze, tīrvērtes mehānismi, tirdzniecības stratēģija, riska tolerance, pieredze un daži mainīgie lielumi, piemēram, laiks, cik ilgi ieguldījumu brokeru sabiedrība ir bijusi iesaistīta algoritmiskajā tirdzniecībā, un tas, kādā mērā tā izmanto pārdevējus, kas ir trešās personas. Ieguldījumu brokeru sabiedrība koriģē minētos tirgus riska un kredītriska limitus, lai ņemtu vērā rīkojumu mainīgo ietekmi uz attiecīgo tirgu saistībā ar dažādiem cenas un likviditātes līmeņiem.
5. Ieguldījumu brokeru sabiedrība automātiski bloķē vai atceļ rīkojumus no tirgotāja, ja tai kļūst zināms, ka minētajam tirgotājam nav atļaujas pārdot konkrētu finanšu instrumentu. Ieguldījumu brokeru sabiedrība automātiski bloķē vai atceļ rīkojumus, ja šie rīkojumi var apdraudēt ieguldījumu brokeru sabiedrības pašu riska sliekšņus. Kontrolpasākumus attiecīgā gadījumā piemēro riska darījumiem ar atsevišķiem klientiem, finanšu instrumentiem, tirgotājiem, tirdzniecības struktūrvienībām vai ieguldījumu sabiedrību kopumā.
6. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ievieš procedūras un mehānismus saistībā ar rīkojumiem, kas automātiski bloķēti ieguldījumu brokeru sabiedrības pirmstirdzniecības kontrolpasākumos, bet ko ieguldījumu brokeru sabiedrība tomēr vēlas iesniegt. Šādas procedūras un mehānismus uz laiku un izņēmuma apstākļos piemēro attiecībā uz konkrētu darījumu. Tos pārbauda riska pārvaldības funkcija un tiem piešķir atļauju ieguldījumu brokeru sabiedrības norīkota persona.

16. pants

Uzraudzība reāllaikā

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība laikā, kad tā nosūta rīkojumus tirdzniecības vietām, reāllaikā uzrauga visas algoritmiskās tirdzniecības darbības, kas notiek ar tās tirdzniecības kodu (tostarp klientu tirdzniecības darbības), lai konstatētu nepienācīgas tirdzniecības pazīmes, tostarp attiecībā uz tirdzniecību dažādos tirgos, aktīvu kategorijās vai ar dažādiem produktiem, ja sabiedrība vai tās klienti ir iesaistīti šādās darbībās.
2. Algoritmiskās tirdzniecības darbību uzraudzību reāllaikā veic tirgotājs, kurš atbild par tirdzniecības algoritmu vai algoritmiskās tirdzniecības stratēģiju, un riska pārvaldības funkcija vai neatkarīga riska kontroles funkcija, kas izveidota šīs normas nolūkā. Minēto riska kontroles funkciju uzskata par neatkarīgu neatkarīgi no tā, vai uzraudzību reāllaikā veic ieguldījumu brokeru sabiedrības darbinieks vai trešā persona, ar nosacījumu, ka šī funkcija nav hierarhiski atkarīga no tirgotāja un nepieciešamības gadījumā var apstrīdēt tirgotāja rīcību 1. pantā minētajā pārvaldības sistēmā.
3. Darbinieki, kas atbild par uzraudzību reāllaikā, savlaicīgi risina ar darbību un regulējumu saistītās problēmas un vajadzības gadījumā ierosina koriģējošus pasākumus.

4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka kompetentā iestāde, attiecīgās tirdzniecības vietas un attiecīgā gadījumā TEP sniedzēji, tīrvērtes dalībnieki un centrālie darījumu partneri var jebkurā laikā piekļūt darbiniekiem, kas atbild par uzraudzību reāllaikā. Šajā nolūkā ieguldījumu brokeru sabiedrība nosaka un periodiski testē savus saziņas kanālus, tostarp saziņas procedūras ārpus tirdzniecības laika, lai nodrošinātu, ka ārkārtas gadījumā darbinieki ar attiecīga līmeņa pilnvarojumu var savlaicīgi savstarpēji sazināties.

5. Sistēmām uzraudzībai reāllaikā ir brīdinājumi reāllaika režīmā, lai palīdzētu darbiniekiem identificēt neparedzētas tirdzniecības darbības, kas veiktas, izmantojot algoritmu. Ieguldījumu brokeru sabiedrībai ir procedūra, ar ko veikt koriģējošus pasākumus iespējami drīz pēc brīdinājuma ģenerēšanas, tostarp nepieciešamības gadījumā veikt pienācīgu atsaukšanu no tirgus. Šīs sistēmas arī ģenerē brīdinājumus saistībā ar algoritmiem un TEP rīkojumiem, kas iedarbina tirdzniecības vietas bloķēšanas mehānismu. Brīdinājumi reāllaikā tiek ģenerēti piecu sekunžu laikā pēc attiecīgā notikuma.

17. pants

Pēctirdzniecības kontrolpasākumi

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība pastāvīgi piemēro pēctirdzniecības kontrolpasākumus, ko tā ir ieviesusi. Ja tiek uzsākts pēctirdzniecības kontrolpasākums, ieguldījumu brokeru sabiedrība veic atbilstīgus pasākumus, kas var ietvert attiecīgā tirdzniecības algoritma vai tirdzniecības sistēmas pielāgojumus vai slēgšanu, vai pienācīgu atsaukšanu no tirgus.
2. Šā panta 1. punktā minētie pēctirdzniecības kontrolpasākumi ietver ieguldījumu brokeru sabiedrības tirgus risku un kredītrisku pastāvīgu novērtēšanu un uzraudzību efektīvu riska darījumu ziņā.
3. Ieguldījumu brokeru sabiedrība glabā tirdzniecības un uzskaites datus, kas ir pilnīgi, precīzi un konsekventi. Ieguldījumu brokeru sabiedrība savus elektroniskās tirdzniecības reģistrus saskaņo ar tirdzniecības vietu, uz kurām tā nosūta rīkojumus, brokeru vai TEP sniedzēju, tīrvērtes dalībnieku vai centrālo darījumu partneru un datu sniedzēju vai citu attiecīgo darījumu partneru sniegto informāciju par neizpildītajiem rīkojumiem un riska darījumiem. Ja iepriekš minētie tirgus dalībnieki informāciju sniedz reāllaikā, tad saskaņošana notiek reāllaikā. Ieguldījumu brokeru sabiedrība spēj reāllaikā aprēķināt savu neizpildīto riska darījumu vērtību un savu tirgotāju un klientu neizpildīto riska darījumu vērtību.
4. Atvasināto instrumentu gadījumā pēctirdzniecības kontrolpasākumi, kas minēti 1. punktā, ietver kontrolpasākumus attiecībā uz maksimālajām garajām, īsajām un kopējām stratēģijas pozīcijām, ar tirdzniecības limitiem, kas jānosaka vienībās, kuras atbilst attiecīgo finanšu instrumentu veidiem.
5. Pēctirdzniecības uzraudzību veic tirgotāji, kas atbild par algoritmu, un ieguldījumu brokeru sabiedrības riska kontroles funkcija.

18. pants

Drošība un piekļuves ierobežojumi

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 1. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība īsteno IT stratēģiju ar noteiktiem mērķiem un pasākumiem, kas:
 - a) atbilst ieguldījumu brokeru sabiedrības darījumdarbības un riska stratēģijai un ir pielāgota operatīvajai darbībai un riskiem, kam tā ir pakļauta;
 - b) balstās uz uzticamu IT organizāciju, tostarp pakalpojumu, darba un izstrādes jomā;
 - c) atbilst efektīvai IT drošības pārvaldībai.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība izveido un uztur atbilstošus mehānismus fiziskās un elektroniskās drošības nodrošināšanai, kas mazina risku saistībā ar uzbrukumiem tās informācijas sistēmām un ietver efektīvu identitātes un piekļuves pārvaldību. Minētie mehānismi nodrošina datu konfidencialitāti, integritāti, autentiskumu un pieejamību un ieguldījumu brokeru sabiedrības informācijas sistēmu uzticamību un robustumu.
3. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nekavējoties informē kompetento iestādi par visiem būtiskajiem fiziskās un elektroniskās drošības pasākumu pārkāpumiem. Tā kompetentajai iestādei iesniedz ziņojumu par incidentu, norādot incidenta veidu, pēc incidenta veikto pasākumus un iniciatīvas, kas veiktas, lai novērstu līdzīgus incidentus nākotnē.
4. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ik gadu veic ielašanās testus un neaizsargātības skenēšanu, lai simulētu kiberuzbrukumus.
5. Ieguldījumu brokeru sabiedrība nodrošina, ka tā spēj identificēt visas personas, kurām ir kritiski svarīgas lietotāja piekļuves tiesības attiecībā uz tās IT sistēmām. Ieguldījumu brokeru sabiedrība ierobežo šādu personu skaitu un uzrauga to piekļuvi IT sistēmām, lai pastāvīgi nodrošinātu izsekojamību.

III NODAĻA

TIEŠA ELEKTRONISKA PIEKĻUVE

19. pants

Vispārīgi noteikumi par TEP

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkts)

TEP sniedzējs izstrādā politiku un procedūras, kas nodrošina, ka tā TEP klientu tirdzniecība atbilst tirdzniecības vietas noteikumiem, lai panāktu, ka TEP nodrošinātājs atbilst Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkta prasībām.

20. pants

TEP sniedzēju kontrolpasākumi

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkts)

1. TEP sniedzējs katra TEP klienta rīkojumu plūsmai piemēro 13., 15. un 17. pantā minētos kontrolpasākumus un 16. pantā noteikto uzraudzību reāllaikā. Minēties kontrolpasākumi un uzraudzība ir nošķirti un ir atšķirīgi no TEP klientu piemērotajiem kontrolpasākumiem un uzraudzības. Konkrēti, TEP klienta rīkojumam vienmēr tiek piemēroti pirmstirdzniecības kontrolpasākumi, ko nosaka un kontrolē TEP sniedzējs.
2. TEP sniedzējs var izmantot paša pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības kontrolpasākumus, trešās personas veiktus kontrolpasākumus vai tirdzniecības vietas piedāvātus kontrolpasākumus un uzraudzību reāllaikā. TEP sniedzējs visos apstākļos saglabā atbildību par minēto kontrolpasākumu efektivitāti. TEP sniedzējs arī nodrošina, ka vienīgi tam ir tiesības noteikt vai mainīt minēto pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības kontrolpasākumu un uzraudzības reāllaikā parametrus vai limitus. TEP sniedzējs pastāvīgi uzrauga pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības kontrolpasākumu sniegumu.
3. Pirmstirdzniecības kontrolpasākumu limiti attiecībā uz rīkojumu iesniegšanu ir balstīti uz kredītu un riska ierobežojumiem, ko TEP sniedzējs piemēro savu TEP klientu tirdzniecības darbībai. Šos limitus nosaka, pamatojoties uz sākotnējo TEP klienta uzticamības pārbaudi un periodisku pārskatīšanu, ko veic TEP sniedzējs.
4. TEP klientiem, kas izmanto sponsorētu piekļuvi, piemēroto kontrolpasākumu parametri un limiti ir tikpat stingri kā tie, kas tiek piemēroti TEP klientiem, kuri izmanto TTP.

21. pants

TEP sniedzēju sistēmu specifikācijas

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkts)

1. TEP sniedzējs pārliecinās, ka tā tirdzniecības sistēmas tam ļauj:
 - a) uzraudzīt TEP klienta iesniegtos rīkojumus, izmantojot TEP sniedzēja tirdzniecības kodu;
 - b) automātiski bloķēt vai atcelt rīkojumus no indivīdiem, kas apkalpo tirdzniecības sistēmas, kuras iesniedz ar algoritmisko tirdzniecību saistītus rīkojumus un kurām nav atļaujas rīkojumus nosūtīt ar TEP;
 - c) automātiski bloķēt vai atcelt rīkojumus no TEP klienta par finanšu instrumentiem, kurus minētajam klientam nav atļauts tirgot, izmantojot iekšējo marķēšanas sistēmu, kas identificē un bloķē atsevišķu TEP klientu vai TEP klientu grupu;
 - d) automātiski bloķēt vai atcelt tādus rīkojumus no TEP klienta, kas pārkāpj TEP sniedzēja riska pārvaldības sliekšņus, piemērojot kontrolpasākumus riska darījumiem ar atsevišķiem TEP klientiem, finanšu instrumentiem vai TEP klientu grupām;
 - e) apstādināt tā TEP klientu rīkojumu plūsmas;
 - f) apturēt vai atsaukt TEP pakalpojumus jebkuram TEP klientam, ja TEP sniedzējs nav pārliecināts, ka turpinātas piekļuves nodrošināšana atbilstu tā noteikumiem un procedūrām attiecībā uz taisnīgu un pienācīgu tirdzniecību un tirgus integritāti;
 - g) vajadzības gadījumā pārskatīt TEP klientu iekšējās riska vadības sistēmas.
2. TEP sniedzējam ir procedūras, lai novērtētu, pārvaldītu un mazinātu tirgus traucējumus un sabiedrībā raksturīgus riskus. TEP sniedzējs spēj identificēt personas, kas jāinformē tādas kļūdas gadījumā, kuras rezultātā rodas riska profila pārkāpumi vai iespējami tirdzniecības vietas noteikumu pārkāpumi.
3. TEP sniedzējs piešķir unikālu identifikācijas kodu, ar ko tas vienmēr spēj identificēt savus dažādos TEP klientus un to TEP klientu tirdzniecības struktūrvienības un tirgotājus, kas iesniedz rīkojumus caur TEP sniedzēja sistēmām;
4. TEP sniedzējs, kas ļauj TEP klientam nodrošināt TEP piekļuvi tā klientiem ("pastarpināta deleģēšana"), spēj identificēt dažādās rīkojumu plūsmas no labuma guvējiem šīs pastarpinātās deleģēšanas ietvaros, taču tam nav nepieciešams zināt šo labuma guvēju identitāti.
5. TEP sniedzējs reģistrē datus par rīkojumiem, kurus iesnieguši tā TEP klienti, tostarp izmaiņas un atcelšanu, brīdinājumus, ko ģenerējušas tā uzraudzības sistēmas, un filtrēšanas procesā veiktās izmaiņas.

22. pants

Potenciālo TEP klientu uzticamības pārbaude

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkts)

1. TEP sniedzējs veic savu potenciālo TEP klientu uzticamības pārbaudi, lai pārliecinātos par atbilstību šajā regulā izklāstītajām prasībām un tās tirdzniecības vietas noteikumiem, kuras piekļuvi tas piedāvā.
2. Šā panta 1. punktā minētā uzticamības pārbaude ietver:
 - a) potenciālā TEP klienta pārvaldības un īpašumtiesību struktūru;
 - b) potenciālā TEP klienta izmantoto stratēģiju veidus;

- c) potenciālā TEP klienta darbības struktūru, sistēmas, pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības kontrolpasākumus un uzraudzību reāllaikā. Ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas piedāvā TEP un ļauj TEP klientiem izmantot trešās personas programmatūru, lai piekļūtu tirdzniecības vietām, nodrošina, ka programmatūra ietver pirmstirdzniecības kontrolpasākumus, kuri ir līdzvērtīgi šajā regulā noteiktajiem pirmstirdzniecības kontrolpasākumiem;
 - d) potenciālā TEP klienta pienākumus attiecībā uz darbību un kļūdu risināšanu;
 - e) perspektīvā TEP klienta vēsturisko tirdzniecības modeli un uzvedību;
 - f) potenciālā TEP klienta paredzamās tirdzniecības līmenī un rīkojumu apjomu;
 - g) potenciālā TEP klienta spēju izpildīt tā finanšu saistības pret TEP sniedzēju;
 - h) potenciālā TEP klienta disciplināro vēsturi, ja tā ir pieejama.
3. TEP sniedzējs, kas ļauj veikt pastarpinātu deleģēšanu, nodrošina, ka potenciālajam TEP klientam, pirms tas piešķir piekļuvi citam klientam, ir uzticamības pārbaudes satvars, kas ir vismaz līdzvērtīgs 1. un 2. punktā minētajam.

23. pants

TEP klientu periodiska pārskatīšana

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 5. punkts)

1. TEP sniedzējs katru gadu pārskata savu uzticamības pārbaudes procesu.
2. TEP sniedzējs katru gadu veic atkārtotu riska novērtēšanu attiecībā uz klientu sistēmu un kontrolpasākumu piemērotību, jo īpaši ņemot vērā izmaiņas to tirdzniecības darbību vai stratēģiju apjomā, būtībā vai sarežģītībā, izmaiņas to darbinieku vidū, īpašumtiesību struktūrā, tirdzniecības vai bankas kontā, tiesiskajā statusā, finanšu stāvoklī un attiecībā uz to, vai TEP klients ir izteicis vēlmi pastarpināti deleģēt piekļuvi, ko tas iegūst no TEP sniedzēja.

IV NODAĻA

IEGULDĪJUMU BROKERU SABIEDRĪBAS, KAS DARBOJAS KĀ VISPĀRĒJI TĪRVĒRTES DALĪBNIEKI

24. pants

Ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas darbojas kā vispārēji tīrvērtes dalībnieki, sistēmas un kontrolpasākumi

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 6. punkts)

Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas darbojas kā vispārējs tīrvērtes dalībnieks ("tīrvērtes sabiedrība"), visām sistēmām, kuras palīdz sniegt tīrvērtes pakalpojumus klientiem, piemēro attiecīgas uzticamības pārbaudes, kontrolpasākumus un uzraudzību.

25. pants

Potenciālo tīrvērtes klientu uzticamības pārbaudes

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 6. punkts)

1. Tīrvērtes sabiedrība veic potenciālā tīrvērtes klienta sākotnējo novērtējumu, ņemot vērā klienta darījumdarbības būtību, apjomu un sarežģītību. Katru potenciālo tīrvērtes klientu novērtē pēc šādiem kritērijiem:
 - a) kredītpēja, tostarp jebkuras sniegtās garantijas;
 - b) iekšējās riska kontroles sistēmas;
 - c) paredzētā tirdzniecības stratēģija;

- d) maksājumu sistēmas un mehānismi, kas ļauj potenciālajam tīrvērtes klientam nodrošināt aktīvu vai naudas kā drošības rezerves savlaicīgu nodošanu, kā pieprasīts no tīrvērtes sabiedrības attiecībā uz tās sniegtajiem tīrvērtes pakalpojumiem;
 - e) sistēmas iestatījumi un piekļuve informācijai, kas ļauj potenciālajam tīrvērtes klientam ievērot jebkādos maksimālos tirdzniecības limitus, par kuriem panākta vienošanās ar tīrvērtes sabiedrību;
 - f) jebkāds nodrošinājums, ko tīrvērtes sabiedrībai sniedzis potenciālais tīrvērtes klients;
 - g) darbības resursi, tostarp tehniskās saskarnes un savienojamība;
 - h) potenciālā klienta iesaiste finanšu tirgu integritāti nodrošinošu tīrvērtes noteikumu pārkāpumos, tostarp iesaiste tirgus ļaunprātīgā izmantošanā, finanšu noziegumā vai nelikumīgi iegūtu līdzekļu legalizēšanas darbībās.
2. Tīrvērtes sabiedrība katru gadu tīrvērtes klientu sniegumu pārskata attiecībā pret šā panta 1. punktā uzskaitītajiem kritērijiem. Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 6. punktā minētā saistošā rakstiskā vienošanās ietver šos kritērijus un nosaka to, cik bieži tīrvērtes sabiedrība pārskata savu tīrvērtes klientu sniegumu attiecībā pret šiem kritērijiem, ja šāda pārskatīšana ir jāveic biežāk kā reizi gadā. Saistošajā rakstiskajā vienošanās izklāsta sekas, kas iestājas tīrvērtes klientiem, kuri neizpilda šos kritērijus.

26. pants

Pozīciju limiti

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 6. punkts)

1. Tīrvērtes sabiedrība nosaka un paziņo saviem tīrvērtes klientiem atbilstošos tirdzniecības un pozīciju limitus, lai mazinātu un pārvaldītu savus darījuma partneru, likviditātes, operacionālos un citus riskus.
2. Tīrvērtes sabiedrība uzrauga savu tīrvērtes klientu pozīcijas attiecībā pret 1. punktā minētajiem limitiem pēc iespējas tuvāk reāllaikam, un tai ar atbilstošām drošības rezervēm un citiem līdzekļiem ir pienācīgas pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības procedūras pozīciju limitu pārkāpuma risku pārvaldībai.
3. Tīrvērtes sabiedrība rakstveidā dokumentē 2. punktā minētās procedūras un reģistrē to, vai tīrvērtes klienti ievēro šīs procedūras.

27. pants

Informācijas atklāšana par sniegtajiem pakalpojumiem

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 6. punkts)

1. Tīrvērtes sabiedrība publicē nosacījumus, saskaņā ar kuriem tā sniedz tīrvērtes pakalpojumus. Tā šos pakalpojumus piedāvā, pamatojoties uz saprātīgiem komerciāliem nosacījumiem.
2. Tīrvērtes sabiedrība tās potenciālos un esošos tīrvērtes klientus informē par aizsardzības līmeņiem un izmaksām, kas saistītas ar dažādajiem nošķiruma līmeņiem, ko tā sniedz. Informācija par dažādajiem nošķiruma līmeņiem ietver attiecīgo piedāvāto nošķiruma līmeņu galveno juridisko seku aprakstu, tostarp informāciju par attiecīgajā jurisdikcijā piemērojamiem maksātnespējas tiesību aktiem.

V NODAĻA

AUGSTAS INTENSITĀTES ALGORITMISKĀS TIRDZNIECĪBAS METODE UN NOBEIGUMA NOTEIKUMI

28. pants

Rīkojumu datu saturs un formāts

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 2. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas izmanto augstas intensitātes algoritmiskās tirdzniecības metodi, nekavējoties pēc rīkojuma iesniegšanas reģistrē datus par katru iesniegto rīkojumu, izmantojot II pielikuma 2. un 3. tabulā norādīto formātu.

2. Ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas izmanto augstas intensitātes algoritmiskās tirdzniecības metodi, atjaunina 1. punktā minēto informāciju, ievērojot standartus un formātus, kas norādīti II pielikuma 2. un 3. tabulas ceturtajā ailē.
3. Datus, kas minēti 1. un 2. punktā, glabā piecus gadus no dienas, kad rīkojums iesniegts tirdzniecības vietai vai citai ieguldījumu brokeru sabiedrībai tā izpildei.

29. pants

Spēkā stāšanās un piemērošana

(Direktīvas 2014/65/ES 17. panta 2. punkts)

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

To piemēro no 2018. gada 3. janvāra.

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

Briselē, 2016. gada 19. jūlijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNKER

I PIELIKUMS

Kritēriji, kas ņemami vērā ieguldījumu brokeru sabiedrības pašnovērtējumā, kā minēts 9. panta 1. punktā

1. Izvērtējot savas darbīumdarbības būtību, ieguldījumu brokeru sabiedrība attiecīgā gadījumā ņem vērā:
 - a) sabiedrības tiesisko statusu un attiecīgā gadījumā tās TEP klientu tiesisko statusu, tostarp regulatīvās prasības, kas uz to attiecas kā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību saskaņā ar Direktīvu 2014/65/ES, un citas attiecīgās regulatīvās prasības;
 - b) sabiedrības lomu tirgū, tostarp to, vai tā ir tirgus līderis un vai tā izpilda klientu rīkojumus, vai arī drīzāk tikai darījumus pēc savas iniciatīvas;
 - c) tirdzniecības un citu sabiedrības procesu vai darbību automatizācijas līmeni;
 - d) sabiedrības tirgoto instrumentu, produktu un aktīvu kategoriju tiesiskā statusa veidus;
 - e) sabiedrības izmantoto stratēģiju veidus un riskus, ko šīs stratēģijas rada sabiedrības pašu riska pārvaldībai, kā arī taisnīgai un pienācīgai tirgus darbībai; sabiedrība jo īpaši ņem vērā šo stratēģiju būtību (piemēram, tirgus veidošana vai arbitražā) un to, vai šīs stratēģijas ir ilgtermiņa, īstermiņa, virziena vai bezvirziena;
 - f) sabiedrības stratēģiju un tirdzniecības darbību letentuma sensitivitāti;
 - g) tirdzniecības vietu tiesiskā statusa un citu likviditātes portfeļu, kam piekļūts, veidus un jo īpaši to, vai tirdzniecības darbība šajās tirdzniecības vietās un citos likviditātes portfeļos ir oficiāla, neoficiāla vai ārpusbiržas tirdzniecība;
 - h) sabiedrības savienojamības risinājumus un to, vai tā piekļūst tirdzniecības vietām kā TEP klients vai kā TEP sniedzējs;
 - i) to, cik lielā mērā sabiedrība ir atkarīga no trešām personām, lai izstrādātu un uzturētu tās algoritmus vai tirdzniecības sistēmas, un vai šie algoritmi vai tirdzniecības sistēmas ir pašu izstrādāti, kopizstrādāti sadarbībā ar trešo personu vai nopirkti no trešās personas, vai arī nodoti ārpakalpojumā trešai personai;
 - j) sabiedrības īpašumtiesību un vadības struktūru, tās struktūru organizatoriski un operacionāli, un to, vai tā ir partnerība, meitas sabiedrība, biržas sarakstā iekļauta sabiedrība vai cita veida sabiedrība;
 - k) sabiedrības riska pārvaldību, atbilstību, revīzijas struktūru un organizāciju;
 - l) sabiedrības nodibināšanas dienu un tās darbinieku kompetences un pieredzes līmeni, kā arī to, vai tā ir nodibināta nesen.
2. Izvērtējot savas darbīumdarbības apjomu, ieguldījumu brokeru sabiedrība attiecīgā gadījumā ņem vērā:
 - a) paralēli darbojošos algoritmu un stratēģiju skaitu;
 - b) tirgoto atsevišķo instrumentu, produktu un aktīvu kategoriju skaitu;
 - c) tirdzniecības struktūrvienību skaitu un atsevišķus par rīkojumu izpildi atbildīgo fizisko personu un algoritmu tirdzniecības identifikatorus;
 - d) ziņojumapmaiņas apjoma jaudu un jo īpaši iesniegto, korigēto, atcelto un izpildīto rīkojumu skaitu;
 - e) monetāro vērtību bruto un neto pozīcijām tekošās dienas ietvaros un uz nakti;
 - f) to tirgu skaitu, kuriem piekļūts locekļa vai dalībnieka statusā, vai izmantojot TEP;
 - g) sabiedrības klientu un jo īpaši sabiedrības TEP klientu skaitu un lielumu;
 - h) to koplietošanas vai tuvmitināšanas vietņu skaitu, ar kurām sabiedrībai ir savienojamība;
 - i) sabiedrības savienojamības infrastruktūras caurlaidspējas apmēru;

- j) sabiedrības tīrvērtes dalībnieku vai CDP dalību skaitu;
- k) sabiedrības izmēru tirgotāju un darījumu, vidējā līmeņa un noformējuma struktūrvienības pilna laika ekvivalenta darbinieku skaita ziņā;
- l) sabiedrības fizisko atrašanās vietu skaitu;
- m) to valstu un reģionu skaitu, kuros sabiedrība veic tirdzniecības darbības;
- n) sabiedrības gada ienākumus un peļņu.

3. Izvērtējot savas darījumdarbības sarežģītību, ieguldījumu brokeru sabiedrība attiecīgā gadījumā ņem vērā:

- a) sabiedrības vai tās klientu izpildīto stratēģiju būtību, ciktāl tās ir zināmas sabiedrībai, un jo īpaši to, vai šīs stratēģijas ietver algoritmus, ar ko uzsāk rīkojumus attiecībā uz saistītiem instrumentiem vai vairākās tirdzniecības vietās vai likviditātes portfeļos;
 - b) sabiedrības algoritmus kodēšanas ziņā, ievaddatus, no kuriem tie ir atkarīgi, savstarpējo atkarību un algoritmos ietvertos noteikumu izņēmumus, vai citādi;
 - c) sabiedrības tirdzniecības sistēmas izmantoto tirdzniecības sistēmu dažādības ziņā, kā arī pakāpi, kādā sabiedrība kontrolē savu tirdzniecības sistēmu noteikšanu, koriģēšanu, testēšanu un pārskatīšanu;
 - d) sabiedrības struktūru īpašumtiesību un pārvaldības ziņā un tās organizatorisko, darbības, tehnisko, fizisko vai ģeogrāfisko uzbūvi;
 - e) sabiedrības savienojamības, tehnoloģijas vai tīrvērtes risinājumu dažādību;
 - f) sabiedrības fizisko tirdzniecības infrastruktūru dažādību;
 - g) sabiedrības izmantoto vai piedāvāto ārpakalpojumu līmeni un jo īpaši ja ārpakalpojumā ir nodotas galvenās funkcijas;
 - h) sabiedrības TEP sniegšanu vai izmantošanu, vai tā ir TTP vai sponsorēta piekļuve, un nosacījumus, saskaņā ar kuriem TEP piedāvā klientiem; kā arī
 - i) sabiedrības vai tās klientu veiktās tirdzniecības ātrumu.
-

II PIELIKUMS

Rīkojumu datu saturs un formāts, kā minēts 28. pantā

1. tabula

Apzīmējumi 2. un 3. tabulai

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
{ALPHANUM-n}	Līdz n burtciparu zīmēm	Brīvas formas teksta lauks.
{CURRENCYCODE_3}	3 burtciparu zīmes	Valūtas trīsburtu kods, kā definēts ar ISO 4217 valūtas kodiem.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datuma un laika formāts saskaņā ar ISO 8601	Datums un laiks šādā formātā: GGGG-MM-DDThh:mm:ss.dddZ. — “GGGG” ir gads, — “MM” ir mēnesis, — “DD” ir diena, — “T” nozīmē, ka ir jāizmanto burts “T”, — “hh” ir stunda, — “mm” ir minūte, — “ss.dddZ” ir sekunde un sekundes daļas, — “Z” ir koordinētais universālais laiks. Datumus un laikus norāda pēc koordinētā universālā laika.
{DECIMAL-n/m}	Decimālskaitlis, kas sastāv no maksimāli n zīmēm, no kurām maksimāli m zīmes var būt cipari aiz komata	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām vērtībām. — Decimāldaļas atdala ar “.” (punkts), — negatīviem skaitļiem priekšā norāda “-” (mīnusa zīme), — vērtības noapaļo un nesaīsina.
{INTEGER-n}	Vesels skaitlis, kas sastāv no maksimāli n cipariem	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām veselu skaitļu vērtībām.
{ISIN}	12 burtciparu zīmes	ISIN kods, kā definēts ISO 6166.
{LEI}	20 burtciparu zīmes	Juridiskās personas identifikators, kas definēts ISO 17442.
{MIC}	4 burtciparu zīmes	Tirgus identifikators, kas definēts ISO 10383.
{NATIONAL_ID}	35 burtciparu zīmes	Identifikators ir izklāstīts 6. pantā un II pielikumā [22. RTS par ziņošanas pienākumiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 26. pantu].

2. tabula

Informācija par katru sākotnējo lēmumu veikt darījumu un no klientiem saņemtajiem rīkojumiem

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
1.	Klienta vārds(-i)	Klienta pilns vārds(-i). Ja ir vairāk nekā viens vārds, visus vārdus iekļauj šajā laukā un atdala ar komatu. Šo lauku atstāj tukšu gadījumā, ja ir piemērojams juridiskās personas identifikators (LEI).	{ALPHANUM-140}

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
2.	Klienta uzvārds(-i)	Klienta pilns uzvārds(-i). Ja ir vairāk nekā viens uzvārds, visus uzvārdus iekļauj šajā laukā un atdala ar komatu. Šo lauku atstāj tukšu gadījumā, ja ir piemērojams LEI.	{ALPHANUM-140}
3.	Klienta identifikācijas kods	Kods, ko izmanto, lai identificētu ieguldījumu brokeru sabiedrības klientu. TEP gadījumā izmanto TEP lietotāja kodu. Ja klients ir juridiska persona, izmanto klienta LEI kodu. Ja klients nav juridiska persona, izmanto {NATIONAL_ID} kodu. Apkopotu rīkojumu gadījumā izmanto karodziņu "AGGR", kā noteikts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/580 (¹) 2. panta 3. punktā. Vēl neveiktas rezervācijas gadījumā izmanto karodziņu "PNAL", kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/580 2. panta 2. punktā. Šo lauku atstāj tukšu tikai tad, ja ieguldījumu brokeru sabiedrībai nav klienta.	{LEI} {NATIONAL_ID} "AGGR" – apkopoti rīkojumi "PNAL" – vēl neveiktas rezervācijas
4.	Tās personas vārds(-i), kas rīkojas klienta vārdā	Šajā laukā ieraksta tās personas vārdu(-us), kas rīkojas klienta vārdā. Ja ir vairāk nekā viens vārds, visus vārdus iekļauj šajā laukā un atdala ar komatu.	{ALPHANUM-140}
5.	Tās personas uzvārds(-i), kas rīkojas klienta vārdā	Šajā laukā ieraksta tās personas uzvārdu(-us), kas rīkojas klienta vārdā. Ja ir vairāk nekā viens uzvārds, visus uzvārdus iekļauj šajā laukā un atdala ar komatu.	{ALPHANUM-140}
6.	Ieguldījumu lēmums sabiedrībā	Kods, ko izmanto, lai identificētu personu vai algoritmu, kas pieder pie tirdzniecības vietas un kas ir atbildīgs par ieguldījumu lēmumu saskaņā ar 8. pantu Komisijas Deleģētajā regulā (ES) 2017/590 (²). Ja fiziska persona atbild par ieguldījuma lēmumu, tad ar {NATIONAL_ID} identificē personu, kura ir atbildīga par ieguldījumu lēmumu vai kurai ir galvenā atbildība par ieguldījumu lēmumu. Ja par ieguldījuma lēmumu ir atbildīgs algoritms, lauku aizpilda saskaņā ar 8. pantu Deleģētajā regulā (ES) 2017/590. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja ieguldījuma lēmumu nav pieņēmusi persona vai algoritms, kas pieder pie ieguldījumu brokeru sabiedrības.	{NATIONAL_ID} – fiziskas personas {ALPHANUM-50} – algoritmi
7.	Sākotnējā līguma apzīmējums	Kods, ko izmanto, lai identificētu rīkojumu, kas saņemts no klienta vai ko ieguldījumu brokeru sabiedrība ģenerējusi pirms pasūtījuma apstrādāšanas un iesniegšanas tirdzniecības vietai vai ieguldījumu brokeru sabiedrībai.	{ALPHANUM-50}
8.	Pirkšanas-pārdošanas rādītājs	Norāda, vai rīkojums ir pārdodams vai pērkams.	"BUY" – pirkt "SELL" – pārdot

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
		Iespējas līgumu un mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā pircējs ir darījuma partneris, kam ir tiesības izmantot iespēju, un pārdevējs ir darījuma partneris, kurš pārdod iespēju un saņem prēmiju. Tādu regulētā tirgū tirgotu nākotnes līgumu un regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu gadījumā, kas nav regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi un regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, kuri attiecas uz valūtām, pircējs ir darījuma partneris, kas pērk instrumentu, un pārdevējs ir darījuma partneris, kurš pārdod instrumentu. Tādu mijmaiņas līgumu gadījumā, kas saistīti ar vērtspapīriem, pircējs ir darījuma partneris, kurš saņem pamatā esošā vērtspapīra cenu svārstību risku un saņem nodrošinājuma summu. Pārdevējs ir darījuma partneris, kas maksā nodrošinājuma summu. Tādu mijmaiņas līgumu gadījumā, kas saistīti ar procentu likmēm vai inflācijas indeksiem, pircējs ir darījuma partneris, kurš maksā fiksētu likmi. Pārdevējs ir darījuma partneris, kas saņem fiksētu likmi. Bāzes mijmaiņas līgumu gadījumā (mijmaiņas līgumi, kurā mainīga procentu likme tiek apmainīta pret mainīgu procentu likmi) pircējs ir darījuma partneris, kurš maksā cenas starpību, un pārdevējs ir darījuma partneris, kas saņem cenas starpību. Tādu mijmaiņas līgumu un regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu gadījumā, kas saistīti ar valūtām, un starpvalūtu mijmaiņas līgumu gadījumā pircējs ir darījuma partneris, kas saņem valūtu, kura ir pirmā no valūtām, kas sakārtotas alfabētiskā secībā saskaņā ar ISO 4217 standartu, un pārdevējs ir darījuma partneris, kurš piegādā minēto valūtu. Tādu mijmaiņas līgumu gadījumā, kas saistīti ar dividendēm, pircējs ir darījuma partneris, kurš saņem līdzvērtīgu faktisko dividenžu maksājumu. Pārdevējs ir darījuma partneris, kas izmaksā dividendes un saņem fiksētu likmi. Atvasinātu finanšu instrumentu gadījumā kredītriska pārvešanai, izņemot iespējas līgumus un mijmaiņas iespējas līgumus, pircējs ir darījuma partneris, kas pērk aizsardzību. Pārdevējs ir darījuma partneris, kas pārdod aizsardzību. Tādu atvasinātu instrumentu līgumu gadījumā, kas saistīti ar precēm vai emisiju kvotām, pircējs ir darījuma partneris, kurš saņem precī vai emisijas kvotu, kas norādīta ziņojumā, un pārdevējs ir darījuma partneris, kurš piegādā minēto precī vai emisijas kvotu. Biržā netirgota procentu likmes nākotnes līguma gadījumā pircējs ir darījuma partneris, kas maksā fiksētu procentu likmi, un pārdevējs ir darījuma partneris, kurš saņem fiksētu procentu likmi. Nosacītās summas pieauguma gadījumā pircējs ir tāds pats kā finanšu instrumenta ieguvējs sākotnējā darījumā, un pārdevējs ir tāds pats kā finanšu instrumenta turētājs sākotnējā darījumā. Nosacītās summas samazinājuma gadījumā pircējs ir tāds pats kā finanšu instrumenta turētājs sākotnējā darījumā, un pārdevējs ir tāds pats kā finanšu instrumenta ieguvējs sākotnējā darījumā.	
9.	Finanšu instrumenta identifikācijas kods	Unikāls un nepārprotams finanšu instrumenta identifikators	{ISIN}

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
10.	Cena	Rīkojuma limita cena, izņemot (ja piemērojams) komisijas maksu un uzkrātos procentus. Apturēšanas rīkojumu gadījumā tā ir apturēšanas cena attiecībā uz rīkojumu. Iespējas līgumu gadījumā tā ir atvasinātā instrumenta līguma prēmija par katru pamatā esošo instrumentu vai indeksa punktu. Cenas starpības derību gadījumā tā ir tieša pamatā esošā instrumenta atsauces cena. Attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumiem tas ir kupons bāzes punktos. Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. Ja cena nav piemērojama, lauku aizpilda ar vērtību "NOAP". Ja cena pašlaik nav pieejama, bet vēl tiks noteikta, vērtība ir "PNDG". Ja norunātā cena ir vienāda ar nulli, izmanto nulles cenu. Attiecīgā gadījumā vērtības nenoapaļo un nesaīsina.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuālā izteiksmē vai kā ienesīgums. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos. "PNDG", ja cena nav zināma. "NOAP", ja cena nav piemērojama.
11.	Cenas apzīmējums	Norāda, vai norunas cena ir izteikta monetārā vērtībā, procentos, ienesīgumā vai bāzes punktos.	"MONE" – monetāra vērtība "PERC" – procenti "YIEL" – ienesīgums "BAPO" – bāzes punkti
12.	Cenas reizinātājs	Pamatā esošā instrumenta vienību skaits, kuras aptver viens atvasināto instrumentu līgums. Monetārā vērtība, uz ko attiecas viens mijmaiņas līgums, ja to daudzuma lauks norāda mijmaiņas līgumu skaitu darījumā. Indeksu nākotnes līgumam vai indeksu iespējas līgumam – summa uz vienu indeksa punktu. Likmēm par starpību – starpības likmes pamatā esošā instrumenta cenas izmaiņas. Šajā laukā ziņotā informācija saskan ar vērtībām, kas norādītas 10 un 26. laukā.	{DECIMAL- 18/17} "1" – neatvasināti finanšu instrumenti, kura tirdzniecība notiek ar līgumiem.
13.	Cenas valūta	Valūta, kurā ir izteikta tirdzniecības cena par finanšu instrumentu, kas saistīts ar rīkojumu (piemērojams, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība).	{CURRENCYCODE_3}
14.	Otrās daļas valūta	Vairāku valūtu vai starpvalūtu mijmaiņas darījumu gadījumā otrās daļas valūta ir valūta, kurā ir denominēta līguma otrā daļa. Mijmaiņas iespējas līgumiem, kura pamatā ir vairāku valūtu mijmaiņas darījums, otrās daļas valūta ir valūta, kurā denominēta mijmaiņas līguma otrā daļa. Šis lauks ir piemērojams tikai procentu likmes un valūtas atvasināto instrumentu līgumiem.	{CURRENCYCODE_3}

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
15.	Pamatā esošā instrumenta kods	Pamatā esošā instrumenta <i>ISIN</i> kods. Amerikas depozitārajiem sertifikātiem, globālajiem depozitārajiem sertifikātiem un līdzīgiem instrumentiem – šo instrumentu pamatā esošā finanšu instrumenta <i>ISIN</i> kods. Konvertējamām obligācijām – instrumenta, uz kuru obligāciju var konvertēt, <i>ISIN</i> kods. Atvasinātajiem instrumentiem vai citiem instrumentiem, kuriem ir pamatā esošs instruments, – pamatā esošā instrumenta <i>ISIN</i> kods, ja instrumenta tirdzniecība ir atļauta vai to tirgo tirdzniecības vietā. Ja pamatā ir akciju dividende – attiecīgās akcijas, kura piešķir tiesības uz pamatā esošajām dividendēm, <i>ISIN</i> kods. Kredītriska mijmaiņas darījumiem norāda atsaucē saistības <i>ISIN</i> kodu. Ja pamatā ir indekss un tam ir <i>ISIN</i> – attiecīgā indeksa <i>ISIN</i> kods. Ja pamatā ir grozs, iekļauj katra groza komponenta, kura tirdzniecība ir atļauta vai kuru tirgo tirdzniecības vietā, <i>ISIN</i> kodu. Šo lauku aizpilda tik daudzas reizes, cik nepieciešams, lai uzskaitītu visus uzrādāmos instrumentus grozā.	{ISIN}
16.	Iespējas līguma veids	Norāde par to, vai atvasinātais instruments ir pirkšanas iespējas līgums (tiesības pirkt konkrētu pamatā esošu aktīvu) vai pārdošanas iespējas līgums (tiesības pārdot konkrētu pamatā esošu aktīvu), vai arī par to, ka rīkojuma izvietošanas laikā nav iespējams konstatēt, vai līgums ir pirkšanas iespējas līgums vai pārdošanas iespējas līgums. Mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā tas ir: — “PUTO” – saņēmēja mijmaiņas iespējas līguma gadījumā, kad pircējam ir tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu kā fiksētas likmes saņēmējam, — “CALL” – maksātāja mijmaiņas iespējas līguma gadījumā, kad pircējam ir tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu kā nemainīgas likmes maksājumu maksātājam. Procentu likmju maksimālās robežvērtības līgumu un procentu likmju minimālās robežvērtības līgumu gadījumā tas ir: — “PUTO” procentu likmju minimālās robežvērtības līguma gadījumā. — “CALL” – procentu likmju maksimālās robežvērtības līguma gadījumā. Lauks attiecas tikai uz atvasinātajiem instrumentiem, kas ir iespējas līgumi vai regulētā tirgū tirgotas garantijas.	“PUTO” – pārdošanas iespējas līgums “CALL” – pirkšanas iespējas līgums “OTHR” – ja nav iespējams konstatēt, vai tas ir pirkšanas vai pārdošanas iespējas līgums
17.	Norunas cena	Iepriekš noteikta cena, par kādu turētājam būs jāpērk vai jāpārdod pamatā esošais instruments, vai norāde, ka rīkojuma izvietošanas laikā cenu nav iespējams noteikt. Lauks attiecas tikai uz tādiem iespējas līgumiem vai regulētā tirgū tirgotām garantijām, kuriem norunas cenu var noteikt rīkojuma izvietošanas laikā. Ja norunas cena nav piemērojama, aili neaizpilda.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuālā izteiksmē vai kā ienesīgums. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos. “PNDG”, ja cena nav zināma.
18.	Norunas cenas valūta	Norunas cenas valūta.	{CURRENCYCODE_3}

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
19.	Avansa maksājums	Visu avansa maksājumu monetārā vērtība pārdevēja saņemtās vai izmaksātās nominālās summas bāzes punktos. Ja pārdevējs saņem avansa maksājumu, ierakstītā vērtība ir pozitīva. Ja pārdevējs izmaksā avansa maksājumu, ierakstītā vērtība ir negatīva. Attiecībā uz atvasināto instrumentu līgumu nosacītās vērtības palielinājumu vai samazinājumu skaitlis atspoguļo izmaiņu absolūto vērtību, un to izsaka kā pozitīvu skaitli.	{DECIMAL-18/5}
20.	Piegādes veids	Norāda, vai darījumu apmaksā fiziskos aktīvos vai skaidrā naudā. Ja piegādes veidu nevar noteikt rīkojuma izvietojuma laikā, vērtība ir "OPTL". Lauks ir jāaizpilda tikai tad, ja ir atvasinātie instrumenti.	"PHYS" – aktīvu fiziska piegāde "PHYS" – norēķini naudā "OPTN" – pēc darījuma partnera izvēles vai tad, ja to nosaka trešā puse.
21.	Iespējas izmantošanas veids	Jānorāda, vai iespējas līgumu var izpildīt tikai konkrētā datumā (Eiropas un Āzijas tips), vairākos iepriekš noteiktos datos (Bermudu tips) vai jebkurā brīdī līguma darbības laikā (Amerikas tips). Šis lauks ir piemērojams tikai attiecībā uz iespējas līgumiem.	"EURO" – Eiropas "AMER" – Amerikas "ASIA" – Āzijas "BERM" – Bermudu "OTHR" – cits veids
22.	Termiņa diena	Finanšu instrumenta [atmaksas] termiņa diena Lauks ir piemērojams tikai parāda instrumentiem ar noteiktu termiņu termiņa dienu.	{DATEFORMAT}
23.	Termiņš	Finanšu instrumenta termiņš. Lauks ir piemērojams tikai atvasinātajiem instrumentiem, kam ir noteikts termiņš.	{DATEFORMAT}
24.	Daudzuma valūta	Valūta, kurā izteikts daudzums. Lauks ir piemērojams tikai tad, ja daudzums ir izteikts kā nomināla vai monetāra vērtība.	{CURRENCYCODE_3}
25.	Daudzuma apzīmējums	Norāda, vai daudzums ir izteikts vienību skaitā, nominālvērtībā vai monetārā vērtībā.	"UNIT" – vienību skaits "NOML" – nominālvērtība "MONE" – monetāra vērtība
26.	Sākotnējais daudzums	Attiecīgā finanšu instrumenta vienību skaits vai atvasināto instrumentu līgumu skaits rīkojumā. Finanšu instrumenta nominālā vai monetārā vērtība. Attiecībā uz cenas starpības derībām daudzums ir monetārā vērtība, par kuru noslēgtas derības uz katru pamatā esošā finanšu instrumenta punkta kustību. Attiecībā uz atvasināto instrumentu līgumu nosacītās vērtības palielinājumu vai samazinājumu skaitlis atspoguļo izmaiņu absolūto vērtību, un to izsaka kā pozitīvu skaitli. Attiecībā uz kredītriska mijmaiņas līgumiem daudzums ir nosacītā summa, par kuru iegādāta vai pārdota aizsardzība.	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.

N.	Lauks	Apraksts	Standarts un formāts
27.	Datums un laiks	Precīzs datums un laiks, kad saņemts rīkojums, vai precīzs datums un laiks, kad tika pieņemts lēmums veikt darījumu. Šo lauku attiecīgā gadījumā saglabā saskaņā ar Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/574 ⁽³⁾ 3. pantu un pielikuma 2. tabulu.	{DATE_TIME_FORMAT} Attiecīgā gadījumā ciparu skaitu aiz "sekundes" nosaka saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/574 pielikuma 2. tabulu.
28.	Papildu informācija no klienta	Norādījumi, parametri, nosacījumi un cita informācija par rīkojumu, ko klients ir nosūtījis ieguldījumu brokeru sabiedrībai.	Brīvā tekstā

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 24. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/580, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par attiecīgu datu, kuri saistīti ar finanšu instrumentu rīkojumiem, saglabāšanu (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 193. lpp.).

⁽²⁾ Komisijas 2016. gada 28. jūlija Deleģētā regula (ES) 2017/590, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem ziņošanai par darījumiem kompetentajām iestādēm (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 449. lpp.).

⁽³⁾ Komisijas 2016. gada 7. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/574, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par uzņēmumu pulksteņu precizitātes līmeni (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 148. lpp.).

3. tabula

Informācija, kas attiecas uz izejošiem un izpildītiem rīkojumiem

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
1.	Pirkšanas-pārdošanas rādītājs	Norāda, vai rīkojums ir par pirkšanu vai pārdošanu, kā noteikts 2. tabulas 8. laukā.	"BUY" – pirkt "SELL" – pārdot
2.	Tirdzniecības statuss	Norāda, vai rīkojums iesniegts tāpēc, ka tirdzniecības vietas loceklis, dalībnieks vai klients veic sapārotu tirdzniecību savā vārdā saskaņā ar Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 38. punktu vai veic darījumus savā vārdā saskaņā ar Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 6. punktu. Ja rīkojums nav iesniegts tāpēc, ka tirdzniecības vietas loceklis, dalībnieks vai klients ir veicis sapārotu tirdzniecību savā vārdā vai veicis darījumus savā vārdā, laukā norāda, ka darījums ir veikts citā statusā.	"DEAL" – darījumu veikšana savā vārdā "MTCH" – sapārota tirdzniecība savā vārdā "AOTC" – jebkurš cits statuss
3.	Likviditātes nodrošināšanas darbība	Norāde par to, vai rīkojums tirdzniecības vietai ir iesniegts tirgus veidošanas stratēģijas ietvaros saskaņā ar Direktīvas 2014/65/ES 17. un 48. pantu vai citas darbības ietvaros saskaņā ar Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/575 ⁽¹⁾ 3. pantu.	"pareizi" "nepareizi"
4.	Izpilde sabiedrībā	Kods, ko izmanto, lai identificētu personu vai algoritmu, kas ir atbildīgs par darījuma, kurš izriet no rīkojuma, izpildi saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/590 9. pantu. Ja par darījuma izpildi ir atbildīga fiziska persona, šo personu identificē ar {NATIONAL_ID}. Ja par darījuma izpildi ir atbildīgs algoritms, lauku aizpilda saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/590 9. pantu.	{NATIONAL_ID} – fiziskas personas {ALPHANUM-50} – algoritmi

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
		Ja darījuma izpildē ir iesaistīta vairāk nekā viena persona vai personu un algoritmu kombinācija, sabiedrība nosaka galveno atbildīgo tirgotāju vai algoritmu, kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/590 9. pantā, un šajā laukā ieraksta minētā tirgotāja vai algoritma identitāti. Šis lauks ir piemērojams tikai attiecībā uz izpildītiem rīkojumiem.	
5.	Tirdzniecības vietai vai citai ieguldījumu sabiedrībai iesniegtā rīkojuma identifikācijas kods	Iekšējais kods, ko ieguldījumu brokeru sabiedrība izmanto, lai identificētu tirdzniecības vietām vai citām ieguldījumu brokeru sabiedrībām iesniegto rīkojumu ar noteikumu, ka kods ir unikāls katrai tirdzniecības dienai un katram finanšu instrumentam.	{ALPHANUM-50}
6.	Rīkojuma identifikācijas kods, ko piešķirusi cita ieguldījumu brokeru sabiedrība vai tirdzniecības vieta, kurā rīkojums tika iesniegts	Burtciparu kods, ko piešķirusi cita ieguldījumu brokeru sabiedrība vai tirdzniecības vieta, kurā ieguldījumu brokeru sabiedrība ir iesniegusi rīkojumu tā izpildei. Šo lauku aizpilda ar identifikācijas kodu, ko piešķir pēdējā minētā ieguldījumu brokeru sabiedrība vai tirdzniecības vieta.	{ALPHANUM-50}
7.	Rīkojuma saņēmēja identifikācijas kods	Tās ieguldījumu brokeru sabiedrības kods, kurai rīkojums nosūtīts, vai tās tirdzniecības vietas kods, kurai rīkojums nosūtīts.	Attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību: {LEI} Attiecībā uz tirdzniecības vietu: {MIC}
8.	Rīkojuma veids	Norāda tirdzniecības vietai iesniegtā rīkojuma veidu saskaņā ar tirdzniecības vietas specifikācijām.	{ALPHANUM-50}
9.	Ierobežojuma cena	Maksimālā cena, par kuru var tirgot pirkšanas rīkojumu, vai minimālā cena, par kuru var tirgot pārdošanas rīkojumu. Stratēģijas rīkojuma starpības cena. Tā var būt pozitīva vai negatīva. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja rīkojumam nav ierobežojuma cenas vai ja rīkojumiem nav noteiktas cenas. Konvertējamās obligācijas gadījumā šajā laukā uzrāda rīkojumam izmantoto faktiskā cenu ("tīro" vai "netīro"). Ja rīkojums ir izpildīts, ieguldījumu brokeru sabiedrība reģistrē arī cenu, par kādu darījums ticis izpildīts.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuāli vai kā peļņas likme. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos.
10.	Cenas valūta	Valūta, kurā ir izteikta finanšu instrumenta, kas saistīts ar rīkojumu, tirdzniecības cena (piemērojams, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība).	{CURRENCYCODE_3}
11.	Cenas apzīmējums	Norāda, vai norunas cena ir izteikta monetārā vērtībā, procentos, ienesīgumā vai bāzes punktos.	"MONE" – monetāra vērtība "PERC" – procenti "YIEL" – ienesīgums "BAPO" – bāzes punkti
12.	Papildu ierobežojuma cena	Citas ierobežojuma cenas, ko var piemērot rīkojumam. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja nav piemērojams.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība.

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
			Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuāli vai kā peļņas likme. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos.
13.	Apturēšanas cena	Cena, kas jāsasniedz, lai rīkojums kļūtu aktīvs. Attiecībā uz apturēšanas rīkojumiem, ko izraisa no finanšu instrumenta cenas neatkarīgi notikumi, šajā laukā ieraksta apturēšanas cenu, kas ir vienāda ar nulli. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja nav piemērojams.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuāli vai kā peļņas likme. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos.
14.	Piesaistīta ierobežojuma cena	Maksimālā cena, par kuru var tirgot pirkšanas rīkojumu ar piesaistītu cenu, vai minimālā cena, par kuru var tirgot pārdošanas rīkojumu ar piesaistītu cenu. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja nav piemērojams.	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuāli vai kā peļņas likme. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos.
15.	Atlikušais daudzums, tostarp slēptais	Kopējais daudzums, kas rīkojumu reģistrā atliek pēc daļējas izpildes vai tāda jebkura cita notikuma gadījumā, kas skar rīkojumu. Daļējas izpildes rīkojuma gadījumā tas ir kopējais atlikušais apjoms pēc minētās daļējās izpildes. Rīkojuma ieraksta gadījumā tas ir sākotnējais daudzums.	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.
16.	Norādītais daudzums	Rīkojumu reģistrā redzamais daudzums (pretstatā slēptajam).	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.
17.	Tirgotais daudzums	Pilnīgas vai daļējas izpildes gadījumā šajā laukā ieraksta izpildes daudzumu.	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
18.	Minimālais pieļaujamais daudzums (MPD)	Minimālais pieļaujamais daudzums rīkojuma izpildei, kas var sastāvēt no vairākām daļējām izpildēm un parasti attiecas tikai uz nepastāvīgiem rīkojumu veidiem. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja nav piemērojams.	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.
19.	Minimālais izpildāmais apjoms (MIA)	Minimālais katras atsevišķas iespējamās izpildes izpildāmais apjoms. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja nav piemērojams.	{DECIMAL-18/17}, ja daudzums ir izteikts kā vienību skaits. {DECIMAL-18/5}, ja daudzums ir izteikts kā monetāra vai nomināla vērtība.
20.	MIA tikai pirmajā izpildē	Norāda, vai MIA attiecas tikai uz pirmo izpildi. Šo lauku var atstāt neaizpildītu, ja nav aizpildīts 19. lauks.	“pareizi” “nepareizi”
21.	Tikai pasīvs rādītājs	Norāda, vai rīkojums tirdzniecības vietai ir iesniegts ar parametru/karodziņu, kas liedz rīkojumu nekavējoties izpildīt pret jebkādiem kontrāriem redzamiem rīkojumiem.	“pareizi” “nepareizi”
22.	Pašizpildes novēršana	Norāda, vai ar rīkojums ir ievadīts ar pašizpildes novēršanas kritēriju, lai to nevarētu izpildīt ar rīkojumu pretējā reģistra pusē, ko ievadījis tas pats loceklis vai dalībnieks.	“pareizi” “nepareizi”
23.	Datums un laiks (rīkojuma iesniegšana)	Precīzs datums un laiks, kad rīkojums iesniegts tirdzniecības vietai vai citai ieguldījumu brokeru sabiedrībai.	{DATE_TIME_FORMAT} Ciparu skaitu aiz “sekundes” nosaka saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/574 pielikuma 2. tabulu.
24.	Datums un laiks (rīkojuma saņemšana)	Precīzs datums un laiks visiem ar rīkojumu saistītajiem ziņojumiem, kas nosūtīti tirdzniecības vietai vai ieguldījumu brokeru sabiedrībai un saņemti no tām.	{DATE_TIME_FORMAT} Ciparu skaitu aiz “sekundes” nosaka saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/574 pielikuma 2. tabulu.
25.	Kārtas numurs	Ieguldījumu brokeru sabiedrība katru 26. laukā uzskaitīto notikumu identificē, izmantojot pozitīvus veselus skaitļus augošā secībā. Kārtas skaitlis ir unikāls katram notikuma veidam, konsekvents attiecībā uz visiem notikumiem, ar ieguldījumu brokeru sabiedrības laika zīmogu un pastāvīgs attiecībā uz dienu, kad iestājas notikums.	{INTEGER-50}
26.	Jauns rīkojums, rīkojuma grozīšana, rīkojuma atcelšana, rīkojuma noraidīšana, daļēja vai pilnīga izpilde	Jauns rīkojums: tirdzniecības vietas uzturētājs saņem jaunu rīkojumu. Izraisīts rīkojums: rīkojums, kas kļūst izpildāms vai, attiecīgā gadījumā, neizpildāms, ja īstenojas iepriekš noteikti nosacījumi.	“NEWO” – jauns rīkojums “TRIG” – izraisīts rīkojums

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
		Tirdzniecības vietas locekļa, dalībnieka vai klienta aizvietots rīkojums: ja tirdzniecības vietas loceklis, dalībnieks vai klients pēc savas iniciatīvas nolēmj mainīt tāda rīkojuma parametru, ko tas iepriekš ir ievadījis rīkojumu reģistrā. Tirgus darbību (automātiski) aizvietots rīkojums: ja tirdzniecības vietas uzturētāja IT sistēmas ir mainījušas rīkojuma parametru. Tas ietver gadījumus, kad rīkojuma ar piesaistītu cenu (<i>peg order</i>) vai apturēšanas rīkojuma ar mainīgu apturēšanas cenas vērtību (<i>trailing stop order</i>) pašreizējos parametrus maina, lai atspoguļotu to, kur rīkojums atrodas rīkojumu reģistrā. Tirgus darbību (cilvēkam iejaucoties) aizvietots rīkojums: ja tirdzniecības vietas uzturētāja darbinieki ir mainījuši rīkojuma parametru. Tas ietver gadījumus, kad tirdzniecības vietas loceklim, dalībniekam vai klientam ir IT problēmas un ir nepieciešams steidzami atcelt tā rīkojumus. Statusa maiņa pēc tirdzniecības vietas locekļa, dalībnieka vai klienta iniciatīvas. Tas ietver aktivēšanu un deaktivēšanu. Statusa maiņa saistībā ar tirgus darbībām. Atcelts pēc tirdzniecības vietas locekļa, dalībnieka vai klienta iniciatīvas. Tirgus darbību atcelts. Tas ietver aizsardzības mehānismu, kas paredzēts ieguldījumu brokeru sabiedrībām, kuras ir iesaistītas algoritmiskajā tirdzniecībā un izmanto tirgus veidošanas stratēģiju saskaņā ar Direktīvas 2014/65/ES 17. un 48. pantu. Noraidīts rīkojums: saņemts, bet tirdzniecības vietas uzturētāja noraidīts rīkojums. Rīkojums, kura termiņš ir iestājies. Ja rīkojumu izņem no rīkojumu reģistra brīdī, kad beidzas tā derīguma termiņš. Daļēji izpildīts: ja rīkojums nav izpildīts pilnībā un atliek izpildāms daudzums. Izpildīts: ja vairs nav daudzuma, kas jāizpilda.	“REME” – tirdzniecības vietas locekļa, dalībnieka vai klienta aizvietots rīkojums. “REMA” – tirgus darbību (automātiski) aizvietots rīkojums. “REMH” – tirgus darbību (cilvēkam iejaucoties) aizvietots rīkojums. “CHME” – statusa maiņa pēc tirdzniecības vietas locekļa, dalībnieka/klienta iniciatīvas. “CHMO” – statusa maiņa saistībā ar tirgus darbībām. “CAME” – atcelts pēc tirdzniecības vietas locekļa vai dalībnieka, vai klienta iniciatīvas. “CAMO” – tirgus darbību atcelts. “REMO” – noraidīts rīkojums “EXPI” – rīkojums, kura termiņš ir iestājies “PARF” – daļēji izpildīts “FILL” – izpildīts {ALPHANUM-4} zīmes, kas vēl netiek izmantotas tirdzniecības vietas pašu klasifikācijā.
27.	Īso pozīciju pārdošanas indikators	Īsās pozīcijas pārdošanas darījums, ko ieguldījumu brokeru sabiedrība noslēgusi savā vārdā vai klienta vārdā saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/590 11. pantu. Ja ieguldījumu brokeru sabiedrība izpilda darījumu klienta vārdā, kurš veic pārdošanu, un ieguldījumu brokeru sabiedrība, rīkojoties, cik vien labi iespējams, nespēj noteikt, vai tas ir īsās pozīcijas pārdošanas darījums, šo lauku aizpilda ar “UNDI”. Ja darījums attiecas uz nosūtītu rīkojumu, kas atbilst nosūtīšanas nosacījumiem saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/590 4. pantu, saņēmēja sabiedrība šo lauku aizpilda saņēmējas sabiedrības ziņojumā, izmantojot informāciju, kas saņemta no nosūtītājas sabiedrības.	“SSHO” – īsās pozīcijas pārdošana bez izņēmumiem “SSEX” – īsās pozīcijas pārdošana ar izņēmumiem “SELL” – nav īsās pozīcijas pārdošanas “UNDI” – informācija nav pieejama

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
		Šis lauks ir piemērojams tikai tad, ja uz instrumentu attiecas Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 236/2012 (?) un pārdevējs ir ieguldījumu brokeru sabiedrība vai ieguldījumu brokeru sabiedrības klients. Šis lauks ir piemērojams tikai izpildītu rīkojumu gadījumā.	
28.	Atbrīvojuma indikators	Norāda, vai darījums tika veikts saskaņā ar pirmstirdzniecības atbrīvojumu atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 600/2014 4. un 9. pantam. Attiecībā uz kapitāla vērtspapīru instrumentiem: “RFPT” = atsauces cenas darījums “NLIQ” = slēgti darījumi ar likvīdiem finanšu instrumentiem “OILQ” = slēgti darījumi ar nelikvīdiem finanšu instrumentiem “PRIC” = slēgti darījumi, kam piemēro nosacījumus, kuri nav pašreizējā tirgus cena par minēto pašu kapitāla finanšu instrumentu. Attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru instrumenti: “SIZE” = virs noteikta darījuma apmēra “ILQD” = nelikvīda instrumenta darījums Šis lauks ir piemērojams tikai tad, ja ir rīkojumi, kas izpildīti, piemērojot atbrīvojumu attiecībā uz tirdzniecības vietu.	Aizpilda vienu vai vairākus šādus karodziņus: “RFPT” – atsauces cena “NLIQ” – slēgts (likvīds) “OILQ” – slēgts (nelikvīds) “PRIC” – slēgts (nosacījumi) “SIZE” – virs noteikta apmēra “ILQD” – nelikvīds instruments
29.	Maršrutēšanas stratēģija	Piemērojamā maršrutēšanas stratēģija saskaņā ar tirdzniecības vietas specifikāciju. Šo lauku atstāj neizpildītu, ja nav piemērojams.	{ALPHANUM-50}
30.	Tirdzniecības vietas darījuma identifikācijas kods	Burtciparu kods, ko darījumam piešķirusi tirdzniecības vieta saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/575 12. pantu. Šis lauks ir piemērojams tikai tad, ja ir rīkojumi, kas izpildīti tirdzniecības vietā.	{ALPHANUM-52}
31.	Derīguma termiņš	Dienas rīkojums (<i>Good-For-Day</i>): rīkojuma termiņš iestājas tās tirdzniecības dienas beigās, kurā tas tika ievadīts rīkojumu reģistrā. Derīgs, līdz tiek atcelts (<i>Good-Till-Cancelled</i>): rīkojums turpinās būt aktīvs rīkojumu reģistrā un būs izpildāms līdz brīdim, kad tas tiek faktiski atcelts. Derīgs līdz noteiktam laikam (<i>Good-till-time</i>): rīkojuma termiņš iestājas vēlākais iepriekš noteiktā laikā pašreizējās tirdzniecības sesijas ietvaros. Derīgs līdz noteiktam datumam (<i>Good-till-date</i>): rīkojuma termiņš iestājas noteikta datuma beigās. Derīgs līdz noteiktam datumam un laikam (<i>Good-Till-Specified Date and Time</i>): rīkojuma termiņš iestājas noteiktā datumā un laikā. Derīgs pēc noteikta laika (<i>Good After Time</i>): rīkojums kļūst aktīvs tikai pēc iepriekš noteikta laikā pašreizējās tirdzniecības sesijas ietvaros.	“GDAY” – dienas rīkojums “GTCA” – derīgs, līdz tiek atcelts “GTHT” – derīgs līdz noteiktam laikam “GTHD” – derīgs līdz noteiktam datumam “GTDT” – derīgs līdz noteiktam datumam un laikam “GAFT” – derīgs pēc noteikta laika

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
		Derīgs pēc noteikta datuma (<i>Good After Date</i>): rīkojums kļūst aktīvs tikai no iepriekš noteikta datuma sākuma. Derīgs pēc noteikta datuma un laika (<i>Good After Specified Date and Time</i>): rīkojums kļūst aktīvs tikai no iepriekš noteikta laika iepriekš noteiktā datumā. Tūlītēji izpildāms vai atceļams (<i>Immediate-or-cancel</i>): rīkojums, ko izpilda brīdī, kad tas ievadīts rīkojumu reģistrā (attiecībā uz daudzumu, ko var izpildīt), un kas nepaliek rīkojumu reģistrā attiecībā uz atlikušo daudzumu (ja tāds ir), kas nav izpildīts. Tūlītēji pilnībā izpildāms vai atceļams (<i>Fill-or-kill</i>): rīkojums, ko izpilda brīdī, kad tas ievadīts rīkojumu reģistrā, ja to ir iespējams pilnībā izpildīt; ja rīkojumu var izpildīt tikai daļēji, to automātiski noraida un tāpēc to nevar izpildīt. Cits: jebkādas papildu norādes, kas ir unikālas attiecībā uz konkrētiem uzņēmējdarbības modeļiem, tirdzniecības platformām vai sistēmām.	“GAFD” – derīgs pēc noteikta datuma “GADT” – derīgs pēc noteikta datuma un laika “IOCA” – tūlītēji izpildāms vai atceļams “F” – tūlītēji pilnībā izpildāms vai atceļams vai {ALPHANUM-4} zīmes, kas vēl netiek izmantotas tirdzniecības vietas pašu klasifikācijā.
32.	Rīkojuma ierobežojums	Atbilstošs beigu cenas pārejas sesijai: ja rīkojums kvalificējas beigu cenas pārejas sesijai. Derīgs izsolei: rīkojums ir aktīvs un var tikt izpildīts tikai izsoles posmos (kurus tirdzniecības vietas loceklis, dalībnieks vai klients, kas iesniedzis rīkojumu, var noteikt iepriekš, piemēram, tirdzniecības sesijas sākumizsole un/vai noslēgumizsole un/vai tekošās dienas izsole). Derīgs tikai nepārtrauktai tirdzniecībai: rīkojums ir aktīvs tikai nepārtrauktas tirdzniecības laikā. Cits: jebkādas papildu norādes, kas ir unikālas attiecībā uz konkrētiem uzņēmējdarbības modeļiem, tirdzniecības platformām vai sistēmām.	“SESR” – atbilstošs beigu cenas pārejas sesijai. “VFAR” – derīgs izsolei “VFCR” – derīgs tikai nepārtrauktai tirdzniecībai {ALPHANUM-4} zīmes, kas vēl netiek izmantotas tirdzniecības vietas pašu klasifikācijā. Šo lauku aizpilda ar vairākiem karodziņiem, kas atdalīti ar komatiem, ja ir piemērojami vairāki veidi.
33.	Derīguma termiņa datums un laiks	Šis attiecas uz laika zīmogu, kas atspoguļo laiku, kad rīkojums kļūst aktīvs vai kad tas visbeidzot tiek izņemts no rīkojumu reģistra. Dienas rīkojums: attiecas uz ievadišanas datumu ar laika zīmogu tieši pirms pusnakts. Derīgs līdz noteiktam laikam: attiecas uz ievadišanas datumu un laiku šim konkrētajam rīkojumam. Derīgs līdz noteiktam datumam: attiecas uz noteikto termiņa datumu ar laika zīmogu tieši pirms pusnakts. Derīgs līdz noteiktam datumam un laikam: attiecas uz noteikto termiņa datumu un laiku. Derīgs pēc noteikta laika: attiecas uz ievadišanas datumu un norādīto laiku, kad rīkojums kļūst aktīvs.	{DATE_TIME_FORMAT} Ciparu skaitu aiz “sekundes” nosaka saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/574 pielikuma 2. tabulu.

N.	Lauks/saturs	Apraksts	Formāts
		Derīgs pēc noteikta datuma: attiecas uz noteikto datumu ar laika zīmogu tieši pēc pusnakts. Derīgs pēc noteikta datuma un laika: pēc noklusējuma attiecas uz ievadišanas datumu un norādīto laiku, kad rīkojums kļūst aktīvs. Derīgs, līdz tiek atcelts: attiecas uz galīgo datumu un laiku, kad rīkojums tiek automātiski izņemts no tirgus darbībām. Cits: laika zīmogs papildu darbības derīguma termiņa veidiem.	
34.	Apkopots rīkojums	Norāda, vai rīkojums ir apkopots rīkojums saskaņā ar Deleģētās regulas (ES) 2017/575 2. panta 3. punktu.	“pareizi” “nepareizi”
35.	Papildu informācijai, kas attiecas uz izejošo rīkojumu	Norādījumi, parametri, nosacījumi un cita informācija par rīkojumu, ko: ieguldījumu brokeru sabiedrība nosūta tirdzniecības vietai un jo īpaši tie norādījumi, parametri, nosacījumi un informācija, kas vajadzīga tirdzniecības vietai, lai būtu skaidra izpratne par to, kā tai jārikojas ar rīkojumu; vai tirdzniecības vieta nosūta ieguldījumu brokeru sabiedrībai un jo īpaši tie norādījumi, parametri, nosacījumi un informācija, kas vajadzīga ieguldījumu brokeru sabiedrībai, lai būtu skaidra atgriezeniska informācija par to, kā tai jārikojas ar rīkojumu.	Brīvā tekstā

(¹) Komisijas 2016. gada 8. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/575, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem saistībā ar darījumu izpildes kvalitātes datiem, kas jāpublicē izpildes vietām (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 152. lpp.).

(²) Eiropas Parlamenta un Padomes 2012. gada 14. marta Regula (ES) Nr. 236/2012 par īso pozīciju pārdošanu un dažiem kredītriska mijmaiņas darījumu aspektiem (OV L 86, 24.3.2012., 1. lpp.).