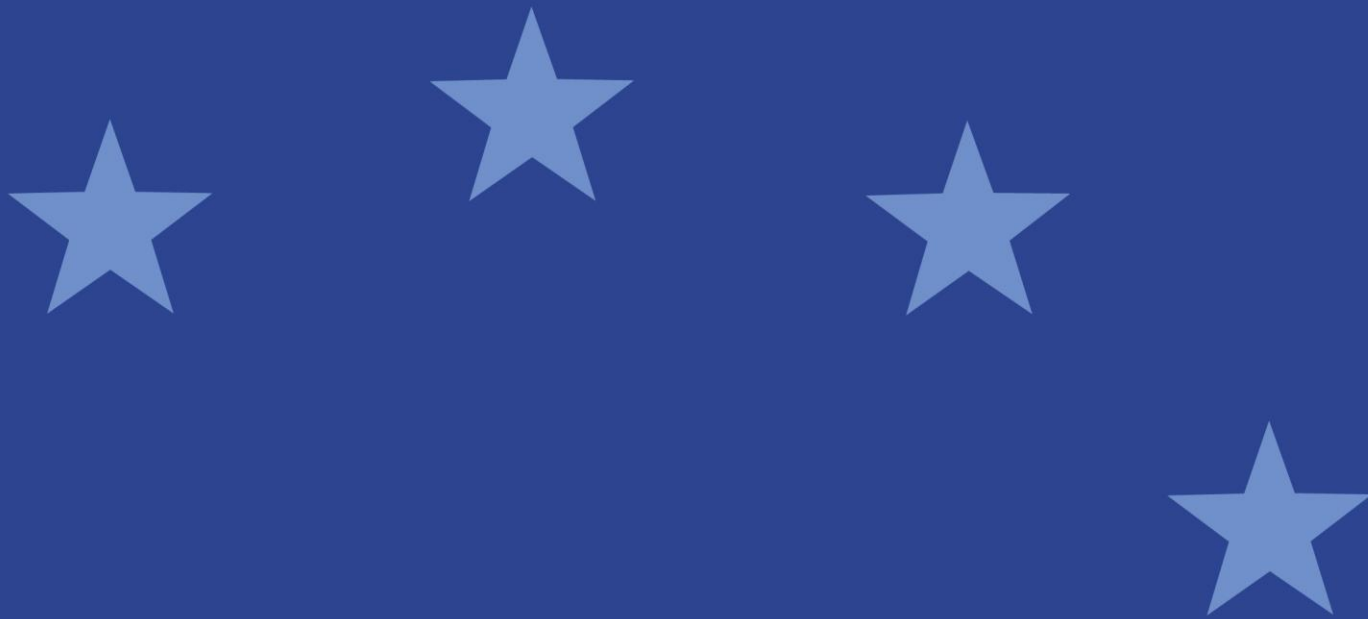


# Насоки

**Отчитане на сделки, документиране на поръчки и синхронизиране на часовници съгласно ДПФИ II**





## Съдържание

Съдържание .....	3
Резюме.....	9
1 Обхват.....	10
2 Определения.....	10
3 Цел.....	11
4 Задължения за спазване на насоките и докладване.....	11
5 Насоки относно отчитането на сделки.....	12
<b>Част I – Общи принципи .....</b>	<b>14</b>
5.1 Общ подход към отчитането.....	14
5.2 Качеството, в което лицето търгува.....	16
5.2.1 Търгуване за собствена сметка (DEAL).....	16
5.2.2 Търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки (MTCH).....	19
5.2.3 Търговия във „всяко друго качество“(АОТС).....	21
5.2.4 Ограничения относно качеството, в което лицето търгува.....	22
5.3 Вериги и предаване .....	22
5.3.1 Общи положения.....	22
5.3.2 Верига, при която дружество търгува за собствена сметка или за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки.....	23
5.3.3 Предаване .....	23
5.4 Изпълнение на сделка на място на търговия .....	25
5.4.1 Идентификационен код на сделката на място на търговия (Поле 3) .....	25
5.4.2 Отчитане на поле място за вериги (поле 36) .....	25
5.5 Идентификатори за страните .....	26
5.5.1 Процедура за генериране на CONCAT .....	26
5.5.2 Собствено(и) име(на) и фамилия(я) .....	29
5.6 Значение на понятието „сделка“ .....	29
5.6.1 Придобивания и продажби .....	29
5.6.2 Изключения от отчитането.....	30
5.7 „Механика“ на отчитане.....	35
5.7.1 Неприложими полета и попълване на полета с референтни данни за инструмента 35	
5.7.2 Подаване на отчети за сделките .....	36
<b>Част II – Клетки .....</b>	<b>37</b>
5.8 Клетка 1: Идентифициране на купувача/продавача.....	37
5.8.1 Купувач/продавач, който отговаря на изискванията за LEI .....	37

5.8.2	Купувачът/продавачът е физическо лице .....	38
5.9	Клетка 2: Вземащият решение за купувача/продавача .....	41
5.9.1	Вземащият решение е купувача/продавача .....	42
5.9.2	Вземащият решение е трета страна с правомощия да представлява купувача/продавача .....	43
5.10	Клетка 3 (комбинация от 1 и 2): Конкретни сценарии за купувача/продавача и вземащия решение .....	45
5.10.1	Купувачът/продавачът е съвместна сметка .....	45
5.10.2	Продавачът е починал .....	46
5.11	Клетка 4: Решението за инвестиция е в рамките на полето „дружество“ .....	47
5.11.1	Решението за инвестиция е в рамките на полето „дружество“ .....	47
5.11.2	Инвестиционно решение, взето извън дружеството (клиентът взема инвестиционното решение и инвестиционният посредник извършва действия на база съответстваща главница или „всяко друго качество“) .....	48
5.12	Клетка 5: Изпълнение в полето дружество .....	49
5.12.1	Лицето носи основната отговорност за изпълнението .....	49
5.12.2	Алгоритъмът носи основната отговорност за изпълнението .....	49
5.13	Клетка 6: Дата и време на търгуване .....	50
5.14	Клетка 7: Място на провеждане .....	50
5.14.1	Изпълнение на сделка на място на търговия в анонимен регистър с поръчки .....	51
5.14.2	Изпълнение на сделка на платформа за търговия извън Съюза в неанонимен регистър с поръчки .....	52
5.14.3	Изпълнение на сделка на място на търговия като улучва своя собствена поръчка в анонимен регистър с поръчки .....	53
5.14.4	Систематичен участник осъществява сделка .....	54
5.15	Клетка 8: Флаг за къса продажба .....	56
5.15.1	Клиент на инвестиционен посредник X извършва къса продажба (информация, известна на дружество X) .....	56
5.15.2	Инвестиционен посредник X осъществява къса продажба от свое име .....	57
5.16	Клетка 9: Показатели за отказ, извънборсови показатели след сделката и показатели за стоков дериват .....	58
5.16.1	Показател за отказ и извънборсов показател след сделката .....	58
5.16.2	Показател след сделка, където инвестиционен посредник съчетава две клиентски поръчки извънборсово .....	63
5.16.3	Показател за стокови деривати .....	63
5.17	Клетка 10: Клонове .....	64
5.17.1	Сделка, извършена от името на клиент .....	64
5.17.2	Сделка, извършена за собствена сметка .....	66
5.17.3	Сделка, изпълнена от клонове от ЕИП на дружества извън ЕИП .....	68

5.18	Клетка 11: Статус на отчетите за сделка и корекциите .....	69
5.18.1	Отменени сделки и изменения в рамките на деня .....	70
5.18.2	Подаване на доклад за нова сделка .....	70
5.18.3	Изпращане на уведомление за анулиране .....	71
5.18.4	Коригиране на информация в отчет за сделка .....	72
5.19	Клетка 12: Условна промяна.....	73
5.19.1	Условно увеличение .....	73
5.19.2	Условно намаление .....	77
5.19.3	Пълно предсрочно прекратяване .....	78
	<b>Част III – Сценарии за търговия</b> .....	<b>79</b>
5.20	Прехвърляне на ценни книжа .....	79
5.20.1	Прехвърляне между клиентите в рамките на едно и също дружество .....	79
5.20.2	Прехвърляне между клиенти на два отделни инвестиционни посредника .....	80
5.20.3	Дружества, които извършват действия извънборсово за съответствие на две клиентски поръчки .....	82
5.21	Инвестиционният посредник представя без да противопоставя поръчки .....	84
5.21.1	Инвестиционен посредник, който съчетава две поръчки от клиенти без да ги противопоставя .....	84
5.21.2	Инвестиционен посредник представя свой клиент на друг инвестиционен посредник без да посредничи.....	85
5.22	Една поръчка за един клиент изпълнена в множество сделки .....	87
5.22.1	Изпълнение на поръчката на клиента чрез изпълнение на място и след това предоставяне на клиента от собствения регистър на инвестиционния посредник.....	87
5.22.2	Изпълнение на поръчката на клиента чрез получаване на част от място и предоставяне на инструментите на клиента от собствения регистър на инвестиционния посредник .....	90
5.23	Групиране на нареждания .....	92
5.23.1	Едно изпълнение на пазара за няколко клиента .....	93
5.23.2	Няколко изпълнения на пазара за няколко клиента .....	96
5.24	организирана система за търговия, която извършва действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ .....	112
5.25	Основани на стойност сделки с балансираща единица .....	117
5.26	Вериги и предаване .....	120
5.26.1	Вериги, където условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) не са изпълнени .	122
5.26.2	Вериги, при които условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) са спазени, но не всички други условия, посочени в член 4, са спазени.....	126
5.26.3	Вериги, при които условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от всички инвестиционни посредници.....	135

5.26.4	Вериги, при които условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от някои инвестиционни посредници във веригата ...	144
5.27	Инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти .....	158
5.27.1	Инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти без да изпълнява условията за предаване (комбинация от обобщени поръчки и вериги/предаване) .....	158
5.27.2	Мениджър на инвестиции, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти и отговаря на условията за предаване .....	170
5.28	Пряк електронен достъп (ПЕД).....	179
5.28.1	Сценарий 1: клиентът за ПЕД търгува за собствена сметка без основен клиент	180
5.28.2	Сценарий 2: Клиент за ПЕД извършва действия от името на клиент .....	182
5.29	Хеджиране посредством договори за разлика (ДР) .....	185
5.30	Отчитане от място на търговия на сделка, изпълнена чрез неговите системи съгласно член 26, параграф 5 от Регламента за пазарите на финансови инструменти .....	188
5.30.1	Дружеството търгува за собствена сметка.....	189
5.30.2	Дружество търгува на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или „всяко друго качество“ за един клиент.....	190
5.30.3	Дружеството събира поръчки за няколко клиента .....	191
5.31	Сделки за финансиране с ценни книжа .....	194
<b>ЧАСТ IV – Отчитане на различни видове инструменти .....</b>		<b>195</b>
5.32	Принципи .....	195
5.33	Идентифициране на финансови инструменти, които са търгувани на място на търговия или присъстват в списък на ESMA.....	195
5.34	Идентифициране на финансови инструменти, които не са търгувани на място на търговия или присъстват в списък на ESMA.....	196
5.34.1	Финансови инструменти, търгувани на организирана платформа за търговия извън Съюза (място извън ЕИП).....	196
5.34.2	Извънборсови деривати.....	197
5.35	Отчитане на специфични финансови инструменти.....	198
5.35.1	Капиталови или сходни с капиталови инструменти .....	198
5.35.2	Облигации или други форми на секюритизиран дълг .....	199
5.35.3	Опции .....	206
5.35.4	Договори за разлики .....	209
5.35.5	Финансово залагане .....	210
5.35.6	Суап за кредитно неизпълнение .....	216
5.35.7	Суапове.....	218
	Докладваната в поле 33 цена трябва да отговаря на стойността на фиксираната ставка в референтните данни на инструмента.....	235

5.35.8	Стокови деривати .....	235
5.35.9	Сложни сделки .....	240
6	Насоки за документиране на поръчки.....	243
	<b>Част I – Общи принципи</b> .....	243
6.1	Обхват на изискванията за документиране на поръчки.....	243
6.2	Членове или участници на място на търговия.....	244
6.3	Код за идентифициране на клиент (поле 3) .....	244
6.3.1	Попълване на поле 3 (код за идентифициране на клиент) в случай на обобщени поръчки	245
6.3.2	Попълване на поле 3 (код за идентифициране на клиент) в случай на предстоящи разпределения .....	245
6.4	Неизпълняващ нарежданията посредник (поле 6) .....	245
6.5	Статус на нареждането (Поле 33).....	246
6.6	Дата и час на периода на валидност (Поле 12).....	246
6.7	Пасивен или агресивен показател (поле 44).....	247
6.8	Идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC) (поле 48).....	247
6.9	Пореден номер (поле 15) .....	247
6.10	Период на валидност (поле 10).....	251
6.10.1	Дневен флаг (DAVY).....	251
6.10.2	Комбинация от два флага на периода на валидност Нарездания, валидни след дата (GADV) и нареждания, валидни до дата (GTDV) .....	251
6.11	Дейност за осигуряване на ликвидност (Поле 8).....	252
	<b>Част II – Сценарии</b> .....	254
6.12	Легенда .....	254
6.13	Централен регистър с лимитирани поръчки .....	254
6.13.1	Нови/отмяна/промяна на поръчки (поле 21) .....	255
6.13.2	Цена на допълнителен лимит (Поле 25) .....	259
6.13.3	Класификация на лимитирана поръчка „айсберг“ .....	260
6.13.4	Пазарно обвързани поръчки .....	263
6.13.5	Класификация на стоп поръчка .....	268
6.13.6	Насочени поръчки.....	270
6.13.7	Класификация на поръчки, подадени съгласно стратегия (поле 46).....	278
6.13.8	Промяна на приоритет .....	294
6.13.9	Фази на търговия .....	298
6.14	Системи за искане на котировка .....	311
6.14.1	Как се регистрира искане на котировка, което е изпратено до определени контрагенти.....	311

6.14.2	Как да регистрирате отговор на котировка с ограничено време на валидност („ефирно време“), което е изпълнимо за конкретен искащ котировка? .....	313
6.14.3	Как да регистрирате отговор на котировка с различно количество от поисканото? .....	314
6.14.4	Как да регистрирате изпълнение в система за искане на котировка? .....	315
7	Насоки относно синхронизирането на часовниците .....	317
7.1	Събития, подлежащи на отчитане .....	317
7.2	Ниво на детайлност на удостоверението за време .....	318
7.3	Спазване на изискванията за максимално отклонение .....	321
7.3.1	Бързи секунди .....	323
7.3.2	Местно време и компенсиране от координираното универсално време .....	323
7.3.3	Приложимост за инвестиционни посредници, които не са преки членове или участници на място на търговия .....	323
7.4	Удостоверения за време за приложение, хост и ефирно време .....	323
7.5	Закъснение „от вход до вход“ .....	324
8	Приложения .....	325
	Приложение I Обработка на отчети, получени от подаващи субекти .....	325



---

## Резюме

### Основания за публикуване

След завършването на неокончателните регулаторни технически стандарти относно отчитането на сделки, документирането на поръчки и синхронизирането на часовници (Делегиран регламент (ЕС) 2017/590<sup>1</sup> на Комисията, Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията и Делегиран регламент (ЕС) 2017/574<sup>2</sup>), ESMA започна собствена инициатива, свързана с мерки за сближаване в областта на надзора относно изпълнението на тези РТС.

Насоките отразяват резултата от настоящата работа и следват Консултативния доклад (КД), публикуван през декември 2015 г.<sup>3</sup>

### Съдържание

Раздели 1, 2 и 3 определят обхвата, определенията и целта на настоящите насоки. Раздел 4 определя процедурата за спазване на насоките. Раздели 5 и 6 посочват отделните сценарии, приложими за дадена сделка и дейността по документиране на поръчки. Всеки от сценариите е придружен от точна техническа инструкция за програмата, която да се използва за представяне на конкретни отчетни стойности. В допълнение към сценариите за отчитане и документиране, тези раздели също предоставят множество други разяснения относно приложението на изискванията съгласно Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията и Делегиран регламент (ЕС) 2017/580, които са поискани от участниците на пазара по време на консултациите относно тези РТС, но не биха могли да бъдат разгледани в окончателните технически стандарти поради нивото на подробност и спецификата на тези искания. Раздел 7 представя разяснения относно приложението на изискванията за синхронизиране на часовници (Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията).

---

<sup>1</sup>

<sup>2</sup> Неокончателните технически стандарти на ESMA, подадени до Европейската комисия на 28 септември 2015 г. (ESMA/2015/1464), са достъпни на уебсайта на ESMA на следния адрес: [https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1464\\_annex\\_i\\_-\\_draft\\_rts\\_and\\_its\\_on\\_mifid\\_ii\\_and\\_mifir.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1464_annex_i_-_draft_rts_and_its_on_mifid_ii_and_mifir.pdf)

<sup>3</sup> Консултативен документ относно насоките за отчитане на сделки, референтни данни, документирането на поръчки и синхронизирането на часовниците (ESMA/2015/1909) е достъпен на уебсайта на ESMA на следния адрес:

[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015-1909\\_guidelines\\_on\\_transaction\\_reporting\\_reference\\_data\\_order\\_record\\_keeping\\_and\\_clock\\_synchronisation.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015-1909_guidelines_on_transaction_reporting_reference_data_order_record_keeping_and_clock_synchronisation.pdf)

# 1 Обхват

## Кой?

Настоящите насоки се прилагат за инвестиционни посредници, места за търговия, одобрени механизми за докладване (ОМД) и компетентните органи.

## Какво?

Настоящите насоки се прилагат по отношение на подаването на отчети за сделки съгласно член 26 на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета (Регламента за пазарите на финансови инструменти)<sup>4</sup>; документирането на поръчки съгласно член 25 на Регламента за пазарите на финансови инструменти и синхронизирането на бизнес часовници в съответствие с член 50 на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (ДПФИ II)<sup>5</sup>.

## Кога?

Насоките се прилагат от 3 януари 2018 г.

# 2 Определения

Термините, използвани в ДПФИ II и Регламента за пазарите на финансови инструменти на Европейския парламент и на Съвета, имат същото значение в настоящите насоки. В допълнение, позоваванията на „дружество“ в настоящите насоки се отнасят до всяко дружество, което не е „инвестиционен посредник“ по смисъла на ДПФИ II, освен ако не е посочено друго.

Позоваванията на конкретно „поле“ в насоките относно отчитането на сделки се отнасят за полетата в таблица 2 на Приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията<sup>6</sup> и в насоките относно документирането на поръчки за полетата в Таблица 2 на Приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията.<sup>7</sup>

---

<sup>4</sup> Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 84).

<sup>5</sup> Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Директива 2002/92/ЕО и на Директива 2011/61/ЕС (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 349).

<sup>6</sup> Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията от 28 юли 2016 година за допълнение на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за докладването на сделки пред компетентните органи. Може да се намери на адрес:

[http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L\\_.2017.087.01.0449.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC](http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0449.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC)

<sup>7</sup> Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията от 24 юни 2016 година за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за съхраняването на съответната информация, свързана с нарежданията относно финансови инструменти. Може да се намери на адрес:

[http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L\\_.2017.087.01.0193.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC](http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0193.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC)

### 3 Цел

Целта на насоките е осигуряването на насоки за инвестиционните посредници<sup>8</sup>, местата на търговия<sup>9</sup>, одобрените механизми за докладване<sup>10</sup> и систематичните участници (СУ)<sup>11</sup> относно спазването на разпоредбите за отчитане и документиране на поръчки на Регламента за пазарите на финансови инструменти и Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията и Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията<sup>12</sup>. Те са разработени за гарантиране на последователност в прилагането на настоящите изисквания. По-специално насоките поставят акцент върху тълкуването на отчетите за сделки и на записите за данните за поръчки за всяко отделно поле за различни сценарии, които могат да се случат. Като се има предвид широкият кръг от потенциални сценарии, настоящите насоки не предоставят изчерпателен списък на всички сценарии. Все пак лицата, попадащи в обхвата на настоящите насоки, следва да прилагат елементите на най-значимия сценарий за тълкуване на своите записи и отчети. Всички концепции, посочени в документа за насоки, са приложими единствено за член 25 от Регламента за пазарите на финансови инструменти относно задълженията за документиране на данните за поръчки, член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти относно задълженията за отчитане на сделки и член 50 относно синхронизирането на бизнес часовниците от ДПФИ II.

Всички собствени и фамилни имена, използвани в настоящите насоки, са измислени.

### 4 Задължения за спазване на насоките и докладване

#### Статус на насоките

Настоящият документ съдържа насоки, издадени съгласно член 16 от Регламента за ESMA. В съответствие с член 16, параграф 3 от Регламента за ESMA компетентните органи и участниците на финансовите пазари трябва да положат всички усилия за спазването на насоките и препоръките.

Компетентните органи, за които се отнасят насоките, следва да ги спазват, като ги включат в своите надзорни практики, включително в случаи, когато определени насоки в документа са насочени предимно към участниците на финансовите пазари.

#### Изисквания към отчетността

Компетентните органи, спрямо които са приложими настоящите насоки, са длъжни да уведомят ESMA дали спазват или възнамеряват да спазват насоките, като изложат причини за неспазването им в срок от два месеца след издаването на насоките от ESMA до: [MiFIRreportingGL@esma.europa.eu](mailto:MiFIRreportingGL@esma.europa.eu). При липса на отговор до изтичането на този срок ще се счита,

---

<sup>8</sup> Съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 1 от ДПФИ II.

<sup>9</sup> Съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 24 от ДПФИ II.

<sup>10</sup> Съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 54 от ДПФИ II.

<sup>11</sup> Съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 20 от ДПФИ II.

<sup>12</sup> Делегиран регламент (ЕС) на Комисията 2017/574 от 7 юни 2016 година за допълване на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти във връзка със степента на точност на бизнес часовниците

че компетентните органи не спазват насоките. На уебсайта на ESMA е достъпен образец за уведомяванията.

От участниците на финансовите пазари не се изисква да докладват дали спазват тези насоки.

## 5 Насоки относно отчитането на сделки

Настоящият раздел относно отчитането на сделки се състои от четири части:

- **Част I — Общи принципи.** Описват общите принципи за приложение относно отчитането на сделки. Те обхващат как да се изготви отчет за сделка и при какви обстоятелства и къде да се изпрати отчета. Те предоставят подходи на високо равнище към отчитането и допълнителни насоки относно определени изключения от значението на сделка, както е посочено в член 2, параграф 5 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.
- **Част II — Клетки.** Обхваща клетки (група от полета), където всяка клетка разглежда съответните полета за дадена тема, с придружаващи примери как да ги попълните. Клетките са структурирани, така че да бъдат независими една от друга.
- **Част III — Сценарии.** Представят примери въз основа на различни сценарии на търговия, които отчитаща се страна може да изпита. По-специално са представени сделки в резултат на подаване на поръчки, групирани поръчки и осигуряване на Пряк електронен достъп (ПЕД).
- **Част IV — Инструменти.** Поставя акцент върху насоките за отчитане за различни финансови инструменти<sup>13</sup> Повечето примери поставят акцент върху деривати, като се има предвид, че тези финансови инструменти имат по-сложен модел на отчитане.

За всеки пример в този документ има съответна таблица със значими полета и очакваното XML-текстово възпроизвеждане на тези данни. Съответната таблица и xml трябва да бъдат тълкувани както следва, освен ако не е посочено друго.

- а) „N“ и „поле“ съответстват съответно на броя и името на полетата в Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, Приложение I, Таблица 2.
- б) Колоната „Стойности“ съдържа очакваната буквална стойност на примера. Буквалните стойности са приложени в единични кавички. В някои случаи, описателна стойност е показана вместо това, напр. „{LEI} на дружество X“. Тези стойности следва да бъдат заменени от действителна стойност, която съответства на описанието. Където са посочени, стойностите на фиктивните предприятия в легендата ще бъдат приложени към XML. Термините в скоби се отнасят за типовете данни, описани в приложение I, таблица 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.
- в) Празните места в колоната „Стойности“ изрично посочват, че тези полета не са приложими и не трябва да бъдат попълвани за илюстрирания конкретен сценарий.

XML-текстови извлечения са осигурени за илюстриране как данните следва да бъдат подадени във файла, предоставен на компетентния орган. За целта на изпълнение на методологията ISO 20022 пълната техническа спецификация на съобщенията следва все пак да бъде прегледана и единствено пълната техническа спецификация, налична на <https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016->

<sup>13</sup> Съгласно определението в член 4, параграф 1, точка 15 от ДПФИ II.

[1521\\_mifir\\_transaction\\_reporting\\_technical\\_reporting\\_instructions.pdf](#) следва да бъде разгледана като правилната спецификация на съобщенията.

Всички инструменти, посочени в примерите, са подлежащи на отчитане финансови инструменти съгласно член 26, параграф 2 от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

Отчитането е единствено показано за страните, разгледани в съответния пример и не следва да бъде прието, че другите страни в подобен пример нямат задължения за отчитане на сделки.

Всички часове са в координирано универсално време, освен ако е посочено друго. Датата и часът са показани с минималното ниво на детайлност, изисквано от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (приложение I, таблица 2, поле 28) и могат да бъдат отчетени на по-високо ниво на детайлност, както е посочено в раздел 7.2 за нивото на детайлност на удостоверението за време.

Цялата търговия се приема за електронна търговия, а не високочестотна търговия за целта на нивото на детайлност на часа, който се отчита.

Когато не е изрично посочено, инвестиционният(те) посредник(ци), чиито отчети са показани, действат във „всяко друго качество“.

**Легенда:**

Дружество X (LEI: 12345678901234567890) е инвестиционен посредник.

Дружество Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) е инвестиционен посредник.

Дружество Z (LEI: 88888888888888888888) е инвестиционен посредник.

Клиент А (LEI: AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA) е юридическо лице.

Клиент Б (LEI: BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB) е юридическо лице.

Клиент В (LEI: CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) е юридическо лице.

Място на търговия М (сегмент MIC: 'XMIC'). Настоящото място на търговия работи с анонимен регистър с поръчки с централен контрагент<sup>14</sup>, който има LEI: 111111111111111111.

Клиент 1: физическо лице, Жан Кокто, френски гражданин, с дата на раждане 4 юни 1962 г. (свързан код: FR19620604JEAN#COCTE).

Клиент 2: физическо лице, Хосе Луис Родригес де ла Торе, испански гражданин, с дата на раждане: 27 февруари 1976 г. Испанският данъчен идентификационен номер за Хосе Луис Родригес де ла Торе е: 99156722Т.

Представител 1: физическо лице, Фабио Лука, италиански гражданин с фискален код: ABCDEF1234567890 и дата на раждане: 11 октомври 1974 г.

Търговец 1: Питър Морган, канадски гражданин (номер на паспорт 1112223334445555), извършващ действия от името на дружество X.

Търговец 2: Питър Джоунс, британски гражданин, с номер на британска национална застраховка AB123456C, извършващ действия от името на дружество X.

Търговец 3: Джон Крос, белгийски гражданин, с номер в Националния регистър: 12345678901, извършващ действия от името на дружество X.

Търговец 4: Мари Клеър, френски гражданин, дата на раждане: 2 декември 1963 г. (свързан код FR19631202MARIECLAIR), извършваща действия от името на дружество Y.

Търговец 5: Джулиет Стивънс, финландска гражданка с личен идентификационен код 311280-888Y, извършваща действия от името на дружество Z.

Търговец 6: Адам Джоунс, унгарски гражданин, дата на раждане: 13 април 1980 г. (свързан код: HU19800413ADAM#JONES), извършващ действия от името на дружество Z.

За запазване на място и акцентиране върху основните въпроси, илюстрирани с примери, е важно да се подчертае, че всеки пример със своята съответна таблица и xml ще разглежда единствено подгрупа от полетата, действително изисквани съгласно Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Полета, които не са конкретно споменати в пример, не могат да бъдат приети за значими. Всички полета, които са значими за действителна сделка, трябва да бъдат отчетени.

За гарантиране на правилно отчитане на сделки, този документ следва да се разглежда заедно със съответните разпоредби на ДПФИ II, Регламента за пазарите на финансови инструменти, както и Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията и Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията. ESMA и компетентните органи могат също да публикуват технически спецификации.

## Част I – Общи принципи

### 5.1 Общ подход към отчитането

Целта на отчитането на сделки е да предоставят на компетентните органи информация за сделките. То цели да предостави представяне на сделка, което информира компетентния орган за всички значими обстоятелства, при които се е състояла сделката. В зависимост от качеството, в което лицето търгува на инвестиционния посредник и дали той търгува за клиент, сделка може да се изисква да бъде отчетана в повече от един отчет.

За изпълнение на своите задължения, както са посочени в съображение 32 на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, компетентните органи могат да изискват точна и холистична представа за сделките, които са в обхвата на изискванията за отчитане съгласно член 26 на Регламента за пазарите на финансови инструменти. Съгласно съображение 11 и както допълнително е посочено в член 15, параграф 5 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, инвестиционен посредник следва да гарантира, че общата представа за отчетите за сделки, докладвани от инвестиционния посредник като изпълняващият субект точно отразява всички промени в своята позиция и в позицията на своите клиенти, които възникват от сделките за отчитане<sup>15</sup> със съответните финансови инструменти по времето, когато сделките са извършени. Например, ако инвестиционен посредник придобива някои финансови инструменти за собствена сметка и след това продава същите инструменти на своя клиент отчетите на инвестиционния посредник следва да посочват, че нетната промяна за инвестиционния

---

<sup>15</sup> Следва да бъде отбелязано, че изискванията за отчитане не са предвидени да отразяват действителната позиция на инвестиционния посредник или на клиента на инвестиционния посредник. Интерес представлява промяната в позицията в резултат на отчетни сделки.

посредник е постоянна и клиентът е придобил инструментите. Този принцип се прилага без значение дали който и да е или всички отчети са подадени от инвестиционния посредник, одобрен механизъм за докладване или място на търговия. Например, инвестиционен посредник, който разчита на място на търговия за отчитане на информацията относно пазарната страна на сделка, не следва да подава отчет за сделка за същата пазарна сделка. Когато тази сделка е за клиент, в съответствие с настоящите насоки, инвестиционен посредник следва да не подава отделен отчет за сделка за сделката на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или „всяко друго качество“, тъй като това ще има въздействието от изкуствено увеличение на броя на сделки, отчетени като изпълнени от този инвестиционен посредник. В допълнение, отделните отчети на инвестиционен посредник за сделка следва да бъдат в съответствие един с друг и точно да отразяват ролята на инвестиционния посредник, неговите контрагенти, клиенти и страните, които извършват действия за клиентите съгласно пълномощно.

Съгласно член 26, параграф 1 от Регламента за пазарите на финансови инструменти, инвестиционните посредници, които изпълняват сделки с финансови инструменти, следва да докладват пълна и точна информация за тези сделки. Това означава, че когато два инвестиционни посредника търгуват един с друг, всеки изготвя свой собствен отчет за сделка, който отразява сделката от неговата гледна точка. В същото време, съдържанието на следните полета (които описват общите целеви елементи на сделката, сключена между двата инвестиционни посредника) следва да съответства в съответните еквивалентни отчети на всеки от двата инвестиционни посредника: място<sup>16</sup>, дата и време на търговия<sup>17</sup>, количество, валута на количеството, цена, валута на цената, авансово плащане, валута на авансовото плащане и данни за инструмента, където е от значение.

Отчетите за сделки на инвестиционен посредник следва да включват не само информацията за пазарната страна на сделката, но също информацията за всяко свързано разпределение до клиента, където е относимо. Например, когато инвестиционен посредник X, който извършва действия от името на клиент, купува финансови инструменти от друго дружество или инвестиционен посредник Y, то X следва да отчете, че е търгувал с Y за сметка на своя клиент<sup>18</sup>. Ако X купува финансови инструменти от собствена сметка и продава споменатите финансови инструменти на клиент, то покупката от инвестиционен посредник Y и продажбата на клиента следва да бъдат отчетени в два отделни отчета за сделки за собствена сметка. По подобен начин, когато инвестиционен посредник сключва сделка с друго дружество или инвестиционен посредник като обобщава няколко клиента той следва да отчете съвкупната (блокова) търговия с предприятието или инвестиционен посредник (пазарна страна), както и отделните разпределения на своите клиенти (клиентска страна).

Например, когато инвестиционен посредник търгува на място на търговия за клиент на база „за собствена сметка“, той следва да подаде два отчета за сделки: един за сделката с мястото на търговия (от страна на пазара) и един за сделката с клиента (от страна на клиента). Когато инвестиционен посредник извършва действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или „всяко друго качество“ за един клиент, тогава той следва да подаде един

---

<sup>16</sup> За пазарни сделки, осъществени на място на търговия (т.е. за разлика от свързаното разпределение на клиента).

<sup>17</sup> Попадащи в обхвата на различни изисквания за нивото на детайлност, приложими за инвестиционните посредници - вижте раздел 7.2

<sup>18</sup> Освен ако не удовлетворява изискванията за предаване съгласно член 4 от РТС 22 – вижте раздел 5.26.



отчет за сделка, който обхваща както пазарната страна, така и клиентската страна и следва да включва всички полета, приложими за клиента. Следната диаграма показва тези концепции:



Client	Клиент
Client Side	От страната на клиента
Investment Firm X	Инвестиционен посредник X
Market Side	От страна на пазара
Investment Firm Y	Инвестиционен посредник Y
Investment Firm Y executed on venue	Инвестиционен посредник Y изпълнил на място
Trading venue	Място на търговия

## 5.2 Качеството, в което лицето търгува

Както е посочено в Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (поле 29), съществуват три различни свързани с търговия качества, които могат да бъдат отчетени: търговия за собствена сметка, търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки и „всяко друго качество“. Отчетеното свързано с търговия качество следва да отразява качеството, в което инвестиционният посредник действително е търгувал и следва да бъде в съответствие с останалата част от информацията в отчета(ите) за сделка на инвестиционния посредник.

### 5.2.1 Търгуване за собствена сметка (DEAL)

Когато инвестиционен посредник търгува за собствена сметка, той следва да бъде отчетен като купувач или продавач в отчета за сделка. Съответният продавач или купувач ще бъде контрагента или клиент или място на търговия<sup>19</sup>, с които инвестиционният посредник търгува. Инвестиционният посредник може да извършва действия просто да осъществява своите собствени сделки или може да извършва действия за своя собствена сметка с оглед да изпълнява поръчки, които е получил от клиента. В последния случай, времето и датата за търговия за отчета от страна на клиента могат да бъдат същите както за отчета от страна на пазара или биха могли да бъдат по-късни, а цената за отчета от страна на пазара и от страна на клиента може да е същия или да се различава.

#### 5.2.1.1 Търговия за собствена сметка

##### Пример 1

<sup>19</sup> Както е посочено в клетка 7.



Инвестиционен посредник X, който извършва действия за собствена сметка на собствено основание, купува финансови инструменти на място на търговия M.

Отчетът на инвестиционен посредник X следва да бъде:

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx>

#### 5.2.1.2 Сделка за клиент

##### Пример 2

Инвестиционен посредник X получава поръчка от клиент, клиент А, за покупка на финансов инструмент. Инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка като купува инструмента на място на търговия M и продава тези инструменти на клиент А.

Както е отчетено по-горе, цената на различите отчети на инвестиционен посредник X може да бъде различна, напр. инвестиционен посредник X може да купи от място на търговия/контрагент при 0.352 GBP и да продаде на клиент А при 0.370 GBP, като при този случай инвестиционен посредник X трябва да се отчита както следва:

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код 5 на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент A
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник X
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
33	Цена	'0,352'	'0,370'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF' <sup>20</sup>

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     ...     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;0.352&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     ...     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;0.37&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

<sup>20</sup> Вижте раздел 5.4 за използването на 'XOFF' в полето място.

### Пример 3

Инвестиционен посредник X получава поръчка от клиент, клиент А, за покупка на финансови инструменти и изпълнява поръчката от собствените си регистри.

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	... <Buyr> <AcctOwnr>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr>
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr>
36	Място на провеждане	XOFF	<Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>

### 5.2.2 Търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки (МТСН)

Член 4, параграф 1, точка 38 от ДПФИ II определя търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки като „сделка, при която посредникът се намесва между купувача и продавача в сделката по такъв начин, че никога не е изложен на пазарен риск по време на изпълнението на сделката (...)“. Следователно, отчетът за сделка следва да посочва, че изпълняващият инвестиционен посредник няма промяна на позицията в резултат на сделката.

Когато съществува само един клиент един отчет за сделка следва да бъде подаден, като включва информация за пазара и клиента. Клиентът(ите) следва да бъдат попълнени в полето купувач/продавач, а мястото или контрагентът следва да бъдат попълнени в полето

продавач/купувач. Когато повече от един клиент участва, съвкупната сметка на клиента (раздел 5.23 относно групиране на поръчки) може да се използва за свързване на пазарната страна с разпределения до всеки клиент, както е показано в пример 61 и отчетите от страна на клиента следва да включват всички приложими полета.

#### Пример 4

Ако сделката в първия пример от 5.2.1 се е случила на място на търговия М в 09:30:42.124356 ч. на 9 юни 2018 г. при цена 0.352 GBP и инвестиционен посредник X извършва действия в търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки, отчетите на дружество X следва да бъдат:

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} за клиент А	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr>
28	Дата и време на търгуване	09.06.2018 г., 09:30:42.124 ч.	<AcctOwnr> <Id>
29	Качеството, в което лицето търгува	'MTCH'	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
33	Цена	'0,352'	</Sellr>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	... <Tx> <TradDt>2018-06-09T09:30:42.124Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

### 5.2.3 Търговия във „всяко друго качество“(АОТС)

Всяка друга дейност, която не попада в определенията на търговия за собствена сметка или търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки следва да се отчита с качеството, в което лицето търгува „всяко друго качество“, което включва къде дейността се осъществява на база посредничество.

#### Пример 5

Инвестиционен посредник X, който търгува от името на клиент А, купува финансови инструменти на място на търговия М. Сделката е изпълнена в 09:30:42.124356 ч. на 9 юни 2018 г. при цена 0.352 GBP.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централния контрагент за място на търговия М	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr>
28	Дата и време на търгуване	09.06.2018 г., 09:30:42.124 ч.	</Buyr> <Sellr>
29	Качеството, в което лицето търгува	'АОТС'	<AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
33	Цена	'0,352'	</Sellr>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	<TradDt> 2018-06-09T09:30:42.124Z </TradDt> <TradgCpcty>АОТС</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn>

			<pre>... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt;</pre>
--	--	--	---

Този отчет за сделка е идентичен с отчета за сделка, който би бил изготвен, ако инвестиционен посредник X извършваше действия „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ освен попълването на поле свързано с търговия качество.

#### 5.2.4 Ограничения относно качеството, в което лицето търгува

Инвестиционни посредници, които търгуват за собствена сметка или за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, извършват действия пряко и не могат да „предават поръчки“ съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията като всички поръчки, които подават до друго дружество или инвестиционен посредник са техни собствени поръчки, а не предаване на поръчка, получена от клиент или в резултат на решение за придобиване или продажба на финансов инструмент за клиент съгласно неограничен мандат. Следователно, когато инвестиционни посредници предават поръчки, но не спазват условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, ESMA единствено очаква от тях да докладват във „всяко друго качество“.

Както беше споменато в раздел 5.28, доставчик за ПЕД следва да се отчита като извършващ действия във всяко друго свързано с търговия качество или за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки.

### 5.3 Вериги и предаване

#### 5.3.1 Общи положения

Верига от отчитане се случва, когато дружество или инвестиционен посредник не изпълнява сделка, но изпраща сделката до друго дружество или инвестиционен посредник за изпълнение. Това включва случай, при който

- (i) дружество или инвестиционен посредник изпраща своята поръчка до дружество за изпълнение;
- (ii) дружество или инвестиционен посредник получава поръчка от своя клиент и я изпраща до друго дружество или инвестиционен посредник за изпълнение; или
- (iii) взема решение за придобиване или продажба на финансов инструмент в съответствие с неограничен мандат, осигурен му от неговия клиент и дава поръчката на друго дружество или инвестиционен посредник.

Освен ако е налице предаване на поръчка по смисъла на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, фактът, че инвестиционен посредник е част от верига няма значение за неговите задължения за отчитане, с изключение че отчетите за сделки на инвестиционния посредник във веригата, който предава поръчка, която не е в съответствие с член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, следва да отразява количество, цена, датата и времето на изпълнение, което му е потвърдено от дружеството или инвестиционния посредник, който е изпълнил неговата поръчка (вж. 5.27.1.2) . Инвестиционният посредник следва да отчита

единствено своята „част“ в рамките на веригата и следователно не трябва да гледа напред или назад във веригата отвъд своя непосредствен контрагент и клиент. Отчитане от инвестиционен посредник във верига, където инвестиционният посредник осъществява дейността съгласно (ii) и (iii) в параграфа по-горе, където условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията не са изпълнени, е същото<sup>21</sup> както когато инвестиционен посредник търгува директно с място или контрагент на пазара или клиент за изпълнение на сделка (вж. подраздел 5.26.2 в част III от насоките).

Условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията не са приложими за дружества. Следователно, когато инвестиционен посредник получава поръчки от дружество, той следва да отчита купувача/продавача като дружеството, което е изпратило поръчката, а не основния клиент на дружеството. Това важи в случай на поръчки, получени от дружество за управление на инвестиции, което не е инвестиционен посредник. Получаващият инвестиционен посредник следва да идентифицира клиента (купувач/продавач) като дружеството за управление на инвестиции, а не основните фондове/клиенти.

### 5.3.2 Верига, при която дружество търгува за собствена сметка или за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки

Инвестиционните посредници, които търгуват за собствена сметка или в търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки извършват действия директно и не се считат за предаващи инвестиционни посредници, като се има предвид, че всяка поръчка, която изпращат на дружество или инвестиционен посредник е тяхна собствена поръчка, а не предаване на поръчка, получена от клиент или в резултат на решение за придобиване или продажба на финансов инструмент за клиент съгласно неограничен мандат. Примери можете да прочетете в подраздел **Error! Reference source not found.** в част III от насоките.

### 5.3.3 Предаване

Инвестиционните посредници, които извършват дейността съгласно (ii) и (iii) в 5.3.1 по-горе имат избор: или да спазват условията за предаване, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията или да отчетат сделката.

Съгласно член 3, параграф 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, „ако инвестиционният посредник е предал нареждане съгласно член 4, не се счита, че е изпълнил сделка“. Получаващото дружество следва да попълни определената информация, посочена в таблицата с полета, в своя собствен отчет за сделка. Получаващото дружество следва да направи това като част от своето нормално отчитане и не се изисква да стане одобрен механизъм за докладване.

В съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (полета 7, 16 и 25), когато инвестиционен посредник осъществява дейността съгласно (ii) и (iii) в 5.3.1 и не изпълнява условията за предаване съгласно член 4 от същия РТС, той следва да отчете сделка и да попълни полето показател за предаване на поръчка с „true“. Получаващият инвестиционен посредник следва да отчита предаващия инвестиционен посредник като свой купувач/продавач. Когато клиент на предаващ инвестиционен посредник има задължения за отчитане, клиентът

---

<sup>21</sup> Въпреки че попълването на предаването на полето показател за поръчка ще бъде различно

следва да отчете предаващия инвестиционен посредник като свой купувач/продавач, а не получаващия инвестиционен посредник (както е посочено в 5.26.3.3).

Когато инвестиционен посредник търгува на място на търговия, което не е организирана система за търговия, като извършва действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или за собствена сметка, инвестиционният посредник не извършва предаване, тъй като той не предава поръчка до инвестиционен посредник, а изпълнява пряко на място на търговия и поле 25 следва да бъде попълнено с „false“.

Изискванията за предаване се прилагат на база „всички или никой“, което означава, че ако дружество, което изпраща поръчка, не предава цялата информация, изисквана за изпълнение на условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, то получаващият инвестиционен посредник следва да отчете все едно не е налице предаване.

Когато е налице предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията това не променя прилагането на член 14 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, така че получаващият инвестиционен посредник следва да изпрати всички отчети до своя компетентен орган по произход.

Предаване не се осъществява между клонове на същия инвестиционен посредник, тъй като те не са отделни юридически лица. От друга страна, когато предаването се осъществява между различни юридически лица в рамките на група, то същите изисквания за отчитане се прилагат за тези дружества все едно те са несвързани инвестиционни посредници или дружества.

Целта на поле 25 (показател за предаване на поръчка) е да посочи, че е имало предаване в рамките на верига до друг инвестиционен посредник без да бъдат изпълнени условията на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Предаващ инвестиционен посредник, който извършва действия в качеството на посредник, следва да отчете „true“ в поле 25 без значение дали инвестиционният посредник се е опитал и не е успял да предаде или просто не е избрал да предаде.

Във връзка с гореспоменатото, следните случаи трябва да бъдат разгледани при попълване на поле 25:

- (i) Когато инвестиционен посредник предава поръчки и изпълнява всички условия, посочени в член 4, той не се отчита.
- (ii) Когато инвестиционен посредник извършва сделки на място на търговия, което не е ОСТ, действашо на принципа на опосредени сделки или за своя сметка, поле 25 (показател за предаване на поръчка) се попълва с „false“.
- (iii) Когато инвестиционен посредник извършва действия за своя сметка или за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, (поле 29 = 'DEAL' / 'MATCH') поле 25 (показател за предаване на поръчка) следва да бъде попълнено с „false“.
- (iv) Когато инвестиционен посредник пренася нареждания на свои клиенти, или прави нареждания в съответствие с дискреционен мандат в полза на клиентите си без да отговаря на условията в член 4, неговият отчет следва да посочва, че той извършва действия във всяко друго свързано с търговия качество (поле 29 = 'AOTC') и поле 25 следва да бъде попълнено с „true“.



- (v) Във всеки друг случай, когато инвестиционният посредник извършва действия във всяко друго свързано с търговия качество (поле 29 = 'АОТС'), поле 25 следва да бъде попълнено с „false“.

## 5.4 Изпълнение на сделка на място на търговия

За целите на поле 36, сделка се счита за изпълнена на място на търговия само когато

- i) интересът към купуване и продаване на двете страни е обединен от мястото на търговия на дискреционна или недискреционна основа

или

- ii) интересът към купуване и продаване на двете страни не е обединен от мястото на търговия на дискреционна или недискреционна основа, но въпреки това сделката попада в обхвата на правилата за това място на търговия и се изпълнява в съответствие с тези правила.

Когато инвестиционен посредник не е пряко участващо на пазара дружество, инвестиционният посредник не се счита за изпълняващ на мястото на търговия за целите на отчитане на сделки.

### 5.4.1 Идентификационен код на сделката на място на търговия (Поле 3)

Съгласно член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията, „операторите на местата на търговия водят регистър на индивидуалния идентификационен код на всяка сделка на място на търговия“ произтичаща от пълното или частичното изпълнение на дадено нареждане, преминало през тяхната основна софтуерна система. Този идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC) е посочен в поле 3 на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, което изисква инвестиционните посредници да го попълнят със съответния TVTIC, генериран от оператора на мястото на търговия „за пазарната страна на сделка, изпълнена на дадено място на търговия“.

Операторите на места на търговия могат също да генерират TVTIC за сделки, които попадат в точка ii) на определението за „изпълнени на място на търговия“, предвидено в гореспоменатия раздел, ако TVTIC се генерира при подобни обстоятелства и инвестиционният посредник получава TVTIC от място на търговия, инвестиционният посредник може да избере да попълни поле 3 на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията със съответния TVTIC, генериран от този оператор на място на търговия.

### 5.4.2 Отчитане на поле място за вериги (поле 36)

Когато отчетът за сделка е за сделка, която е изпълнена на място на търговия както е разяснено в параграф 5.4 по-горе, със систематичен участник или на организирана платформа за търговия извън Съюза, поле 36 на отчета от гледна точка на пазара следва да бъде попълнено с MIC кода на мястото, платформата за търговия или систематичния участник. Всички други отчети във веригата следва да бъдат запълнени с 'XOFF'.

## 5.5 Идентификатори за страните

Дружествата, които отговарят на изискванията за LEI, следва да бъдат идентифицирани с LEI съгласно член 26, параграф 6 от Регламента за пазарите на финансови инструменти и член 5 и приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. По-специално, тези дружества включват събирателни дружества, общества, асоциации и физически лица, които извършват действия в рамките на стопанската си дейност<sup>22</sup>. Клон следва да бъде идентифициран с LEI на своята централа, дори ако може да се счита за отговарящ на изискванията за LEI в някои случаи<sup>23</sup>.

Въпреки че изпълняващите инвестиционни посредници следва да гарантират, че техният LEI се подновява съгласно условията на който и да е от акредитираните местни оперативни звена на световните системи за идентификационен код на правния субект съгласно член 5, параграф 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, не съществува изискване съгласно член 13, параграф 3 за гарантиране, че LEI за клиент или контрагент е подновен.

Член 6 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията посочва, че физическо лице следва да бъде идентифицирано с националния идентификатор, посочен в приложение II към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Важно е да се отбележи, че член 26, параграф 1 от Регламента за пазарите на финансови инструменти предвижда, че инвестиционните посредници следва да отчитат правилните и точните данни на сделките. Като се има предвид, че идентификаторите на физически лица са сред данните на отчета, които принадлежат на дадена сделка, изискването за отчитане на правилни и точни данни е валидно в еднаква степен за идентификатори на физически лица. За гарантиране на изпълнението на това изискване, инвестиционните посредници могат, между другото, да поискат от физическото лице да удостовери правилността и валидността на идентификатора като предостави официални документи. Когато клиентът не е осигурил идентификатор, инвестиционният посредник не би могъл да спазва тази част от изискването за отчитане на сделка.

Член 6, параграф 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията не посочва случая на физическо лице, което е гражданин на повече от една държава извън ЕИП. Подобни случаи следва да бъдат разрешени от същата процедура за сортиране, приложена за разрешаване на множество националности от ЕИП.

### 5.5.1 Процедура за генериране на CONCAT

CONCAT кодът не следва да се използва като идентификатор по подразбиране и никога не следва да се използва за тези държави, които съгласно таблицата в приложение II не са избрали CONCAT кода като идентификатор в която и да е от трите приоритетни възможности.

---

<sup>22</sup> Физически лица, извършващи действия в рамките на стопанската си дейност, се считат за инвестиционни посредници при определени обстоятелства, определени в член 4, параграф 1, точка 1 от ДПФИ. Становището на Регулаторния надзорен комитет на ИКПС относно допустимостта на физически лица, които извършват действия в рамките на стопанската си дейност следва да бъде прочетено за допълнителна информация ([http://www.leiroc.org/publications/gls/lou\\_20150930-1.pdf](http://www.leiroc.org/publications/gls/lou_20150930-1.pdf)).

<sup>23</sup> Съгласно становището на Регулаторния надзорен комитет на ИКПС от 11 юли 2016 г., определени клонове могат да бъдат сметени за допустими за LEI съгласно условията, посочени в него. Становището на Регулаторния надзорен комитет на ИКПС следва да бъде разгледано за допълнителна информация ([http://www.leiroc.org/publications/gls/roc\\_20160711-1.pdf](http://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf)).

За целите на създаване на CONCAT, следният метод от четири стъпки трябва да бъде приложен:

#### 1. Получаване на собствено име и фамилия

За свеждане до минимум на риска от разлика в правописа или използването на съкращения, инвестиционният посредник следва да гарантира, че правописът на пълното име на лицето е правилен. Използване на кратки форми и съкращения не е позволено.

#### 2. Премахване на звания

Всички представки към имената, които обозначават звания, позиция, професия или академична квалификация, трябва да бъдат премахнати. Това включва, но не се ограничава до следния списък; списъкът не прави разграничение между главни и малки букви:

адв., треньор, г-жа, д-р, отче, управител, почитаеми, госпожо, госпожице, учителю, г-ца, господине, г-н, г-жа, г-ца, тх, служба, доктор, президент, проф., преподобни, господине

#### 3. Премахване на представки.

ам, ауф, ауф дем, аус дер, д, да, де, де л', дел, де ла, де ле, ди, до, дос, ду, им, ла, ле, мак, мк, мхак, мхик, мхик гиола, мик, ни, нй, ник, о, о́, юа, юи, юй, ван, ван де, ван ден, ван дер, вом, вон, вон дем, вон ден, вон дер

Представките към фамилиите, които не са включени по-горе, или представките към името, т.е. МакДоналд, МакКристал, О'Браян, О'Нийл, не следва да се премахват; но обърнете внимание, че апострофите се премахват на следващата стъпка. Гореспоменатият списък не прави разграничение между главни и малки букви.

#### 4. Транслитерация на апострофи, ударения, тирета, празни пространства и подобни

Следната таблица за транслитерация трябва да се използва, знак по знак, за собственото име и фамилията. Описано по принцип, транслитерацията запазва всички английски букви A-Z или a-z и премахва всички диакритични знаци, апострофи, тирета, пунктуационни знаци и празни места.

##### *Таблица за транслитерация*

Следната таблица посочва един начален знак до един резултатен знак. Тази таблица следва да се прилага за собствено име и фамилия преди получаване на първите пет знака, както е посочено в член 6, параграф 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

За всички имена, които са изписани на кирилица, гръцка или всяка друга нелатинска азбука, и където латинска форма не присъства, следва да се прилага транслитерация на английския вариант на името като се използват правилата на азбуката.

Резултат	Начални знаци	Начални точки за Unicode код
A	Ä ä À à Á á Â â Ã ã Ä å Ă ă Ą ą Ħ ħ Æ æ	U+00C4 U+00E4 U+00C0 U+00E0 U+00C1 U+00E1 U+00C2 U+00E2 U+00C3 U+00E3 U+00C5 U+00E5 U+01CD U+01CE U+0104 U+0105 U+0102 U+0103 U+00C6 U+00E6



Ели	Одегард	NO19760315ELI##ODEGA	Разширено изписване на „Ели“ до 5 знака. Преобразувано Ø в О, и å в А
Уилеке	де Бруин	LU19660416WILLEBRUIJ	Премахната представка ‘Де’
Джон Иан	Деуит	US19650417JON##DEWIT	Разширено изписване на „Джон“ до 5 знака. Пренебрегване на „лан“, само собственото име следва да се използва. Частта „Де“ от „Деуит“ не е представка.
Ейми-Али	Гаркао де Магалаес	PT19900517AMYALGARCA	Премахнато тире от собствено име. Транслитерирани знаци.
Джовани	Дос Сантос	FR19900618GIOVASANTO	Премахната представка.
Гюнтер	Вос	DE19800715GUNTEVOS##	Преобразувано ù в U, и ß в S

## 5.5.2 Собствено(и) име(на) и фамилия(я)

За целите на попълване на всички полета, които изискват „Собствено(и) име(на)“ или „Фамилия(и)“ в приложение I таблица 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, следва да се прилага единствено стъпка 1 („Получаване на собствено име и фамилия“) и стъпка 2 („Премахване на звания“) от метода, описан в раздела 5.5.1 „Процедура за генериране на CONCAT“. По този начин транслитерацията не е приложима и представките не трябва да бъдат премахвани. Всички знаци, използвани от държава от ЕС, включително различителни варианти, могат да бъдат използвани. Всички букви в представки, имена и фамилии следва да бъдат с главна буква.

## 5.6 Значение на понятието „сделка“

### 5.6.1 Придобивания и продажби

Както беше обяснено във въведението към клетка 1, компетентните органи се интересуват от промените в собствеността на финансови инструменти за целите на пазарни злоупотреби. Движения, които не водят до промяна на собствеността, не подлежат на отчитане. Един пример е движението от клиентска сметка, оперирана съгласно неограничен мандат до сметка, оперирана единствено на база изпълнение.

Изключение от това е едновременното придобиване и продажба, конкретно посочени в член 2, параграф 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, където е налице публикуване след сделката. Това важи единствено за случай, при който инвестиционен посредник улучва своя собствена поръчка в регистъра с поръчки на място на търговия. Пример за отчитане за тази ситуация е предвиден в раздел 5.14.3.

## 5.6.2 Изключения от отчитането

### 5.6.2.1 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква а)

За целта на член 2, параграф 5, буква а) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, следните примери трябва да бъдат разгледани:

#### Пример 6

*Два инвестиционни посредника сключват споразумение за обратно изкупуване (репо сделка) във връзка с държавна дългосрочна облигация. Един от инвестиционните посредници отчита сделка съгласно Предложението за регламент на Европейския парламент и на Съвета относно докладването и прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа.*

Не съществува задължение за отчитане на сделка за която и да е от инвестиционните посредници, тъй като тази сделка е отчетена съгласно Предложението за регламент на Европейския парламент и на Съвета относно докладването и прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа.

#### Пример 7

*Инвестиционен посредник, който извършва действия за колективна инвестиционна схема съгласно неограничен мандат, сключва споразумение за обратно изкупуване (репо сделка) във връзка с държавна дългосрочна облигация. Като се допуска че фондът има задължения за отчитане съгласно Предложението за регламент на Европейския парламент и на Съвета относно докладването и прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа, а инвестиционният посредник няма.*

Не съществува задължение за отчитане на сделка за инвестиционния посредник съгласно Регламента за пазарите на финансови инструменти, тъй като сделката е отчетена съгласно Предложението за регламент на Европейския парламент и на Съвета относно докладването и прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа.

### 5.6.2.2 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква б)

Относно инструкциите за предоставяне /плащане в рамките на прехвърлянето, контрагентите за клиринг и/или сетълмент (включително централни депозитари на ценни книжа) не попадат в обхвата на изискванията за отчитане съгласно член 2, параграф 5, буква б) на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, единствено инвестиционният посредник, който изпълнява сделката, трябва да се отчита.

По подобен начин, в случай на уреден извънборсов договор, новацията в различни уредени договори не се отчита.

### 5.6.2.3 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква г)

#### Пример 8

*Попечител/посочено лице решава да премести финансови инструменти от една банка депозитар в друга банка депозитар.*

Не съществува задължение за отчитане на сделка за движението на финансовия инструмент, тъй като тази дейност е възникнала единствено в резултат на попечителска дейност.

#### Пример 9

Клиент прехвърля финансови инструменти на попечител/номинирано лице, за да бъдат държани по неговата попечителска сметка/сметка на номинирано лице.

Не съществува задължение за отчитане на сделка за това прехвърляне, тъй като то е единствено свързано с попечителска дейност.

#### 5.6.2.4 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква д)

Член 2, параграф 5, буква д) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията изключва от свързаните със сделката прехвърляния и новации след сделката с договори за деривати, когато една от страните по договора за дериват е заменена от трета страна. Следователно, предсрочно прекратяване на договор поради клиринг и последващата новация на същото, което води до замяна на първоначална страна по договора не подлежи на отчитане.

#### 5.6.2.5 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква ж)

Член 2, параграф 5, буква ж) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията изключва от сделка *„създаването или обратното изкупуване на предприятие за колективно инвестиране от страна на администратора на предприятието за колективно инвестиране“*.

За борсово търгувани фондове, този процес на създаване или обратно изкупуване на дял в колективна инвестиционна схема, който се случва между оторизиран участник и администратора на колективната инвестиционна схема не подлежи на отчитане на сделка. Този процес обхваща случаи, когато оторизираният участник осигури основните финансови инструменти, които съставляват колективната инвестиционна схема на нейния администратор в замяна на получаване на дял от колективната инвестиционна схема (създаване). Изключението важи също за обратния процес (обратно изкупуване). Тази дейност е изключена, тъй като съществува минимален риск от пазарна злоупотреба, тъй като това е административен процес с икономически еквиваленти, които се разменят.

Инвестиционен посредник купува дялове в колективна инвестиционна схема, която може да бъде или да не бъде борсово търгуван фонд, директно от управителя или администратора на колективната инвестиционна схема по цена, определена съгласно проспекта на колективната инвестиционна схема. Сделката представлява създаване на дялове, така че не подлежи на отчитане от инвестиционния посредник. По подобен начин, ако сделката беше продажба от инвестиционния посредник при същите условия, това би представлявало обратно изкупуване на дялове и не би подлежало на отчитане.

Това изключение важи единствено за процеса на създаване/обратно изкупуване, който се случва с администратора на колективна инвестиционна схема. Щом единицата е създадена, всички покупки и продажби на единицата на вторичния пазар (включително извън пазара) следва да бъдат отчетени, без значение дали цената на придобиване или продажба е по нетна стойност на актива (NAV).

#### Пример 10



*Инвестиционен посредник X (оторизиран участник) желае да получи нови дялове в колективна инвестиционна схема от нейния администратор в отговор на търсене на дялове от клиенти.*

Ако инвестиционен посредник X желае да придобие основните финансови инструменти, които съставляват колективната инвестиционна схема на вторичния пазар за осъществяване на процеса на създаване, то тези придобивания на основните финансови инструменти следва да бъдат отчетени като сделки, като се приема, че основните финансови инструменти се отчитат съгласно член 26, параграф 2.

Ако инвестиционен посредник X тогава извърши размяна в натура с доставчик на колективна инвестиционна схема на основни финансови инструменти за нови дялове, това не трябва да бъде отчетено като сделка от инвестиционен посредник X или администратор на колективна инвестиционна схема, тъй като това е част от процеса на създаване.

#### 5.6.2.6 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква з)

Упражняването на финансов инструмент като опция, покрит варант, конвертируема или заменяема облигация, право на разпределение или право на записване от собственика на финансовия инструмент не поражда задължения за отчитане на сделки за инвестиционния посредник, който упражнява опцията или инвестиционния посредник, срещу който е упражнена<sup>24</sup>. Когато упражняването води до предоставянето на друг финансов инструмент, това също не се отчита от инвестиционния посредник, който упражнява опцията или от инвестиционния посредник, срещу който е упражнена/прехвърлена.

#### Пример 11

*Инвестиционен посредник X упражнява финансов инструмент, не съществува задължение за отчитане на сделка във връзка с упражняването на финансовия инструмент.*

Когато инвестиционен посредник X упражнява финансов инструмент и получава основни финансови инструменти вместо пари в брой, резултатното придобиване на основния финансов инструмент също не подлежи на отчитане.

Когато инвестиционен посредник X упражнява финансов инструмент и трябва да избере дали да получи пари в брой или основни финансови инструменти, това не подлежи на отчитане.

#### Пример 12

*Държател на финансов инструмент или конвертируема дългосрочна облигация упражнява финансов инструмент или конвертируема дългосрочна облигация. В резултат на това упражняване или преобразуване, инвестиционен посредник X (страната, срещу която се упражнява) придобива или продава основни финансови инструменти (напр. на място на търговия), така че може да предостави тези инструменти на държателя.*

---

<sup>24</sup> Упражняването срещу дружество включва случаи за борсово търгувани деривати, при което на инвестиционния посредник или на неговия клиент е възложено да предостави (основния инструмент) в резултат на процеса на възлагане и сделката с основния инструмент се изпълнява от централния контрагент и/или клирингови членове на централния контрагент, за изпълнение на инструкциите за упражняване на друга страна.



Отчет(и) за сделка следва да бъдат подавани по отношение на придобиването/продажбата на основни финансови инструменти (напр. придобиване на място). Все пак, не съществува задължение за отчитане на сделка във връзка с прехвърлянето на тези основни финансови инструменти на държателя или във връзка с упражняването/ конвертирането на финансовия инструмент.

#### 5.6.2.7 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква и)

Съществува изключение от изключението в член 2, параграф 5, буква и), което гласи, че когато дейностите в член 2, параграф 5, буква и) се случват във връзка с първични публични предлагания, вторични публични предлагания, пласиране или емисия на дълг, те следва да бъдат отчетени.

Изключението съгласно член 2, параграф 5, буква и) включва прекратяването на финансови инструменти на техния падеж на датата на изтичане.

Когато придобивания или продажби се случват във връзка със сливания, придобивания и производства по несъстоятелност съгласно Регламент на Съвета (ЕО) № 1346/2000<sup>25</sup>, сплитове на акции и обратни сплитове на акции, те не подлежат на отчитане. В тези случаи, условията обикновено са определени предварително на събранието на акционерите, показани са чрез съответно обявление с информация, и инвеститорите попадат в обхвата на това споразумение без инвеститорият да взема допълнителни решения.

Издаването на дивиденди под формата на акции не подлежи на отчитане съгласно изключението по-горе тъй като то включва създаването на финансови инструменти в резултат на предварително определени договорни условия, при което никакво инвестиционно решение не се взема от инвеститора по времето на създаването на инструментите.

Автоматични увеличения или намаления на условна сума, които произтичат от амортизационни планове, също не подлежат на отчитане, тъй като условията вече са определени в момента във времето на първоначалния договор като никакво решение не е взето по времето на намалението/увеличението на условната сума.

Все пак, събития, при които инвеститорият взема решение в момента на създаване, изтичане или обратно изкупуване, подлежат на отчитане. Тези събития включват случаи, когато клиентът избира да получи пари в брой или инструменти в оферта за придобиване или когато емитентът има избор дали да плати в брой или във финансови инструменти.

#### Пример 13

*Инвестиционен посредник X държи облигации в дружество, които имат падеж 5 години. Съгласно условията на издаване, дружеството има правото да изкупи обратно част от финансовите инструменти преди падеж. В година 3, дружеството изкупува обратно част от номиналната стойност на облигационната емисия.*

---

<sup>25</sup> Регламент (ЕО) № 1346/2000 на Съвета от 29 май 2000 г. относно производството по несъстоятелност

Не съществува задължение за отчитане на сделка във връзка с обратното изкупуване на облигации. Причината за това е, че то е резултат от предварително определени договорни условия, които са извън контрола на инвеститора (инвестиционен посредник X).

#### 5.6.2.8 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква л)

Член 2, параграф 5, буква л) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията изключва от сделка „придобиване, съгласно план за реинвестиране на дивиденди“.

Програма за реинвестиране на дивиденди или план за реинвестиране на дивиденди (ПРД) е възможност за инвестиране на капиталови инструменти, където вместо получаването на дивиденди директно като пари в брой инвеститорът избира предварително неговите дивиденди да бъдат пряко реинвестирани в основния капиталов инструмент.

Във връзка с горепосоченото описание, не съществува задължение за отчитане на сделки за придобиването на предприятието.

#### 5.6.2.9 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква м)

Това изключение не е валидно за отчитането на блокови поръчки (обобщени придобивания и продажби от пазара от името на клиенти в рамките на обхвата на спестовни планове, свързани с инвестиции и планове за оттегляне на инвестиции), тъй като въпреки че придобиванията и продажбите следват план, решение се взема в момента на придобиване или продажба и следователно не всички установени за изключенията условия са изпълнени.

#### Пример 14

*Дружество предлага на своите служители възможността да придобият акции, съгласно програма, при която количеството акции, които се придобиват, е равно на 3 % от годишната заплата на служителя, като акциите се закупуват в последния ден на всяко тримесечие по пазарна цена с отстъпка и при условие че служителят е съобщил своето решение за покупка не по-късно от края на предходния месец.*

*Дружеството предвижда инвестиционен посредник X да разпредели акциите на служителите и да получи плащанията от името на дружеството, като банка посредник.*

*Служител решава да купи акции посредством програмата през март за 350 EUR (пазарна цена). Служителят също участва през септември за 375 EUR и през декември за 400 EUR.*

Инвестиционен посредник X няма каквито и да е задължения за отчитане на сделки за сделки през март, септември или декември, тъй като всяко от придобиванията не надвишава 500 EUR на месец и това не е еднократна сделка в рамките на програмата, въпреки че надвишава 1000 EUR общо.

#### 5.6.2.10 Изключения съгласно член 2, параграф 5, буква н)

#### Пример 15

*Дружество прави тръжна оферта за откупуване на свои облигации от инвеститорите като заплати премия. Условията за офертата вече са публикувани в оповестяване на информация*

или проспект. Дружеството ангажира инвестиционен посредник X да извършва действия като мениджър.

Не съществуват задължения за отчитане на сделки за инвестиционен посредник X или инвеститорите, тъй като условията са публикувани предварително и инвеститорите са имали избор да приемат или отхвърлят тръжната оферта.

## 5.7 „Механика“ на отчитане

Описание как компетентните органи обработват отчети, получени от подаващите субекти, е поместено в приложение I към настоящите насоки.

### 5.7.1 Неприложими полета и попълване на полета с референтни данни за инструмента

Когато таблицата с полета посочва, че дадено поле не е приложимо при обстоятелствата, определени в описанието на полето или в таблицата за валидиране, достъпна на [уебсайт на ESMA – [https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521\\_mifir\\_transaction\\_reporting\\_technical\\_reporting\\_instructions.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf)], това поле не трябва да бъде попълнено и докладът за сделка следва да бъде отхвърлен, ако не е в съответствие с валидиранията, посочени в таблицата на уебсайта на ESMA. Например, когато предприятие посочи в отчета, че изпълнението се е състояло по алгоритъм, поле 60 (държава на клона, който извършва надзор на лицето, отговарящо за изпълнението) не следва да се попълва.

Случаят с попълването на референтните данни е малко различен. Таблица 2 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията посочва, че полета 42 - 56 (полета за референтни данни за инструмента) не са приложими, когато сделките са изпълнени на място на търговия или с инвестиционен посредник, който извършва действия като систематичен участник или когато референтните данни за ISIN, докладвани от инвестиционния посредник в поле 41, са в списъка с референтни данни от ESMA. Когато едно от тези условия е изпълнено, инвестиционните посредници не трябва да попълват тези полета. ESMA също счита, че всяка друга сделка, изпълнена на място на търговия с инструмент, за който инвестиционният посредник е изпълнил поне една сделка на тази дата на търговия на място на търговия или с инвестиционен посредник, който извършва действия като систематичен участник, изпълнява условията, посочени в таблица 2 и така полетата за референтни данни за инструмента не се изискват за подобна сделка.

#### Пример 16

Инвестиционен посредник X купува инструмент Y на място на търговия и по-късно същия ден продава инструмент Y извънборсово на друг инвестиционен посредник или дружество. Инструмент Y не е в списъка с референтни данни, осигурен от ESMA<sup>26</sup>. Покупката се е състояла на място на търговия и по този начин полетата с референтни данни за инструмента не трябва да бъдат попълнени за доклада за сделката за покупка. Сделката за продажба пряко не изпълнява условията, тъй като не се търгува на място на търговия, все пак тъй като сделката за покупка е

---

<sup>26</sup> При невероятния случай, в който място на търговия не успява да изпрати референтни данни за инструмента.

изпълнена в същия ден на място на търговия, полетата с референтни данни за инструмента за отчета за сделката по продажба също не трябва да бъдат попълвани.

Когато тези условия не са изпълнени, инвестиционните посредници следва да попълнят всички полета 42 - 56, които са от значение за инструмента.

Все пак, компетентните органи не следва да отхвърлят доклада за сделка, ако инвестиционните посредници попълнят полетата с референтни данни на инструмента, при което инструментът се търгува на място на търговия или е в списъка на ESMA.

## 5.7.2 Подаване на отчети за сделките

Съгласно член 26, параграф 7 от Регламента за пазарите на финансови инструменти, инвестиционен посредник може да разчита на място на търговия за отчитане на информацията относно пазарната страна на сделка, изпълнена на място на търговия. Местата на търговия могат също да предлагат услугата отчитане на информация за клиентската страна на сделка, която не е изпълнена чрез техните системи, при условие че те се регистрират като одобрен механизъм за докладване.

Когато място на търговия подава отчети от името на инвестиционен посредник, то следва да подаде информацията до компетентния орган, до който инвестиционният посредник трябва да я подаде, без значение къде се намира мястото на търговия.

Когато място на търговия подава отчети за сделки, изпълнени от дружество съгласно член 26, параграф 5 от Регламента за пазарите на финансови инструменти, то следва да подаде информацията до своя компетентен орган по произход.

### 5.7.2.1 Срок за подаване на отчети за сделки

#### 5.7.2.1.1 Надеждност на отчетността

Сделките следва да достигнат до компетентния орган по произход на инвестиционните дружества<sup>27</sup> не по-късно от 23:59:59 ч. местно време на компетентния орган по произход в работния ден след деня на сделката (т.е. за сделки, изпълнени в ден Т, сделките следва да бъдат отчетени не по-късно от 23:59:59 ч. на ден Т+1). Инвестиционните посредници могат да отчетат данните на своите сделки, изпълнени в ден Т също на същия ден (т.е. в ден Т) без значение дали отчетите са изготвени директно от инвестиционните посредници или от одобрен механизъм за докладване, който извършва действия от тяхно име или от мястото на търговия, през чиято система сделките са осъществени. Това означава, че дружествата трябва да подадат информацията до мястото на търговия или одобрения механизъм за докладване навреме за мястото или одобрения механизъм за докладване да подадат отчет до компетентния орган в рамките на срока Т+1.

#### 5.7.2.1.2 Работен ден

Работните дни са всички дни от седмицата с изключение на съботите и неделите и с изключение на всички официални национални празници в държавата членка на националния компетентен орган, до който отчетът за сделка е подаден.

---

<sup>27</sup> Или в случая с места на търговия, които се отчитат от името на членове, които не са инвестиционни посредници, компетентния орган по произход на мястото на търговия.

## Част II – Клетки

### 5.8 Клетка 1: Идентифициране на купувача/продавача

Компетентните органи се интересуват от основния клиент за целите на пазарни злоупотреби, а не от собственика на законното право. Следователно, съществува движение, което води до промяна в собствеността за клиент, клиентът следва да бъде отчетен като купувач/продавач както е уместно, а не всеки попечител/номинирано лице, което може да притежава законното право. Все пак, с изключение на предаването, при което условията за предаване съгласно член 4 са изпълнени, което е обхванато в раздел 5.26.3, инвестиционните посредници следва да отчитат своя директен клиент. Инвестиционният посредник не се очаква да проучва техния клиент или контрагент, за да се опита да определи крайния клиент. Например, когато инвестиционен посредник не разполага с данните на основния клиент(и), не се изисква да проучва тръста до основния клиент(и) на тръста, а само да отчете тръста като купувач/продавач (който следва да се идентифицира със своя LEI код). Все пак, когато инвестиционният посредник познава клиента и изготвя договор за доверително управление както за самостоятелно набирана лична пенсия клиентът следва да бъде отчетен като купувач /продавач, а не тръста.

Обърнете внимание, че бизнес казусите 5.8.1 - 5.10.1 по-долу показват идентифицирането и допълнителните данни за купувачите, но същият подход се прилага за продавачите.

#### 5.8.1 Купувач/продавач, който отговаря на изискванията за LEI

Това е приложим при следните обстоятелства:

Купувач/продавач е дружество или инвестиционен посредник, който е пазарен контрагент;

Купувач/продавач е централен контрагент (прилага се, когато сделката е на място на търговия в анонимен регистър с поръчки с централен контрагент);

Купувач/продавач е инвестиционен посредник, който извършва действия като систематичен участник;

Купувач/продавач е клиент, който отговаря на изискванията за LEI (вж. раздел 5.5 относно идентификаторите за страните в част I).

#### Пример 17

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент А, който купува финансовия инструмент.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<Tx> <New> ...
9	Купувач - собствено (и) име (на)		<Buyr> <AcctOwnr>
10	Купувач - фамилия (и)		<Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI>

11	Купувач - дата на раждане		<pre> &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
----	---------------------------	--	---

## 5.8.2 Купувачът/продавачът е физическо лице

### 5.8.2.1 Купувачът/продавачът е гражданин на държава от ЕИП (една националност)

Съгласно член 6 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията физическо лице следва да бъде идентифицирано в отчета чрез използването на последователност от ISO 3166-1 алфа-2 код на държава на националността на лице, следван от идентификатора, посочен в приложение II към този РТС на базата на националността на лицето. Освен това, съгласно член 7 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, ако клиентът е физическо лице, отчетът за сделка следва да включва пълното име и дата на раждане на клиента.

#### Пример 18

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент 2, който купува финансовия инструмент.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Хосе Луис Родригес де ла Торе	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;JOSE, LUIS&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;RODRIGUEZ, DE LA TORRE&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1976-02-27&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;ES99156722T&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ХОСЕ, ЛУИС'	
10	Купувач - фамилия (и)	'РОДРИГЕС, ДЕ ЛА ТОРЕ'	
11	Купувач - дата на раждане	27.02.1976	

Идентификаторът, който се използва, се определя от националността на лицето, а не къде живеят или мястото на инвестиционно дружество X.

Тъй като инвеститора е испански гражданин, идентификаторът е данъчен идентификационен номер (Código de identificación fiscal) съгласно приложение II от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Името на схема „NIDN“ се отнася за използването на национален идентификатор на клиент. Стойността на „CCPT“ посочва използването на номер на паспорт, а последователност от националност, дата на раждане и съкращение на име се идентифицира с име на схема „CONCAT“. Двата примера след този раздел илюстрират трите ползвания.

#### 5.8.2.2 Купувачът/продавачът е гражданин на държава извън ЕИП (едно гражданство)

##### Пример 19

Инвестиционен посредник X продава, от своя сметка, финансов инструмент на клиент. Клиентът е американски гражданин Пол О'Конър, който живее в Португалия. Неговата рождена дата е 4 март 1941 г.

Както е посочено в приложение II от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията номерът на американски паспорт следва да се използва за идентифициране на Пол О'Конър в отчета за сделка, защото, за целите на отчитане на сделки, именно националността определя използвания идентификатор, а не резидентността на лицето.

Номерът на американския паспорт на Пол О'Конър е 123456789ZZ.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Пол О'Конър}	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;PAUL&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;O'CONNOR&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1941-03-04&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;US123456789ZZ&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ПОЛ'	
10	Купувач - фамилия (и)	'О'КОНЪР'	
11	Купувач - дата на раждане	04.03.1941	

Ако Пол О'Конър няма номер на американски паспорт, то поле 7 следва да бъде попълнено със свързан номер, генериран като US19410304PAUL#OCONN.

### 5.8.2.3 Купувачът/продавачът има двойно гражданство (две държави от ЕИП)

#### Пример 20

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент.

Клиентката Ан-Мари Берг, която купува финансовия инструмент, има шведско и френско гражданство, а датата ѝ на раждане е 3 декември 1963 г.

В съответствие с изискванията на член 6, параграф 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, ISO 3166 алфа кодът за Франция (FR) се намира по азбучен ред преди Швеция (SE). Следователно, първият приоритетен номер за Франция следва да се използва, който е CONCAT кода (Приложение II от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията), а не шведския личен идентификационен номер. CONCAT номерът следва да бъде FR19631203ANNEMBERG#.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Ан-Мари Берг	<TxRpt> <Tx> <New>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'АН-МАРИ'	... <Buyr>
10	Купувач - фамилия (и)	'БЕРГ'	<AcctOwnr> <Id>
11	Купувач - дата на раждане	03.12.1963	<Prsn> <FrstNm>ANNE-MARIE</FrstNm> <Nm>BERG</Nm> <BirthDt>1963-12-03</BirthDt> <Othr>  <Id>FR19631203ANNEMBERG#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>  ... </New> </Tx>

### 5.8.2.4 Купувач/продавач има двойно гражданство (държава от ЕИП и държава извън ЕИП)

#### Пример 21



Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент, Дейвид Стефан, който купува финансовия инструмент. Клиентът има австралийско и румънско гражданство и датата му на раждане е 8 май 1952 г.

Съгласно член 6, параграф 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията националност от ЕИП има приоритет и следователно румънски национален идентификационен номер (Cod Numeric Personal) следва да се използва.

Румънският национален идентификационен номер на Дейвид Стефан е 1234567890123.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Дейвид Стефан}	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Prsn&gt;             &lt;FrstNm&gt;DAVID&lt;/FrstNm&gt;             &lt;Nm&gt;ŞTEFAN&lt;/Nm&gt;             &lt;BirthDt&gt;1952-05-08&lt;/BirthDt&gt;             &lt;Othr&gt;               &lt;Id&gt;RO1234567890123&lt;/Id&gt;               &lt;SchmeNm&gt;                 &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;               &lt;/SchmeNm&gt;             &lt;/Othr&gt;           &lt;/Prsn&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ДЕЙВИД'	
10	Купувач - фамилия (и)	'СТЕФАН'	
11	Купувач - дата на раждане	08.05.1952	

В примера по-горе, ако лицето няма румънски национален идентификационен номер, номерът на румънския паспорт следва да се използва. Ако лицето няма паспорт, следва да се използва CONCAT кодът. CONCAT кодът следва да бъде RO19520508DAVIDSTEFAN.

## 5.9 Клетка 2: Вземащият решение за купувача/продавача

Бизнес казусите по-долу показват идентифицирането на вземащия решение за купувача, но същият подход се прилага за вземащия решение за продавача.

Както е посочено в таблица 2 от приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, полетата за купувач, който взема решението (полета 12-15) са единствено приложими, когато клиентът е купувач и инвестиционното решение е взето съгласно пълномощно. Пълномощното се отнася за трета страна или трети страни, които са външни за клиента и им е предоставено право да вземат инвестиционни решения от името на клиента. Трета(и) страна(и) могат да не бъдат свързани с изпълняващия инвестиционен посредник или

самата тя може да бъде изпълняващ инвестиционен посредник. Пълномощното може да бъде предоставено от клиент, който е физическо лице или юридическо лице и лица, на които е предоставено право да извършват действия за клиента, също могат да бъдат физически или юридически лица.

Ако третата страна е инвестиционния посредник, поле 12 следва да се попълни със самоличността на инвестиционния посредник, а не всяко физическо лице, вземащо решение в този инвестиционен посредник (физическото лице, вземащо решение е обхванато от поле 57).

Това се случва при следните обстоятелства:

когато лицето с пълномощно инструктира инвестиционния посредник (това включва свързаните с пълномощното процедури); или

съгласно неограничен мандат, предоставен от купувача на изпълняващия инвестиционен посредник.

Когато купувач/продавач е предоставил пълномощно на повече от едно лице, единствено лицето(та), инструктирало(ли) инвестиционния посредник, следва да бъде попълнено в полето за вземащия решение.

При всякакви други обстоятелства допускането е, че вземащият решение е купувач и в тези случаи полетата, свързани с вземащия решение (полета 12-15) не са попълнени. Това също включва случай, когато има свързана с пълномощно процедура, но купувачът е взел решението за дадена сделка, а не лицето(та) с пълномощното.

Препоръките и съветите не представляват инвестиционни решения и следователно когато единствено препоръка или съвет е налице, полето за вземащия решение не следва да се попълва.

В конкретния случай с фондове и управители на фондове, управителят на фонд следва да бъде идентифициран от инвестиционния посредник, който изпълнява неговата поръчка като купувач/продавач и полетата за вземащ решение не следва да бъдат попълнени, докато липсва предаване, което отговаря на условията на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (вж. раздел 5.27.1).

### 5.9.1 Вземащият решение е купувача/продавача

#### Пример 22

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент А, който купува финансовия инструмент. Решението за покупка е взето от клиент А.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<Tx> <New> ...

9	Купувач - собствено (и) име (на)		<pre> &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA &lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
10	Купувач - фамилия (и)		
11	Купувач - дата на раждане		
12	Код на вземащия решение за покупка		
13	Лице, което взема решението за купуване - собствено (и) име (на)		
14	Лице, което взема решението за купуване - фамилия (и)		
15	Лице, което взема решението за купуване - дата на раждане		

Тъй като решението за инвестиция е взето от купувача, полетата за вземащия решение са празни.

## 5.9.2 Вземащият решение е трета страна с правомощия да представлява купувача/продавача

### 5.9.2.1 Вземащият решение е страна с пълномощно

#### Пример 23

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за своя клиент Шон Мърфи, който купува финансовия инструмент.

Шон Мърфи е ирландски гражданин, а неговата рождена дата е 27 февруари 1976 г. Г-н Мърфи е упълномощил за своята сметка адвоката си Томас МакКормак, който е ирландски гражданин, роден на 12 декември 1951 г. Нарездането за покупка е подадено от г-н МакКормак.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Шон Мърфи	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Prsn&gt;             &lt;FrstNm&gt;SEAN&lt;/FrstNm&gt;             &lt;Nm&gt;MURPY&lt;/Nm&gt; </pre>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ШОН'	
10	Купувач - фамилия (и)	'МЪРФИ'	
11	Купувач - дата на раждане	27.02.1976	

12	Код на вземащия решение за покупка	{NATIONAL_ID} на Томас МакКормак	<pre> &lt;BirthDt&gt;1976-02-27&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;IE19760227SEAN#MURPH&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;DcsnMakr&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;THOMAS&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;MACCORMACK&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1951-12-12&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;IE19511212THOMAMACCO&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/DcsnMakr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
13	Лице, което взема решението за купуване - собствено (и) име (на)	'ТОМАС'	
14	Лице, което взема решението за купуване - фамилия (и)	'МАККОРМАК'	
15	Лице, което взема решението за купуване - дата на раждане	12.12.1951	

Тъй като Шон Мърфи и Томас МакКормак са и двамата ирландски граждани, свързаният код ще се използва, тъй като това е първият приоритет за Ирландия. Те следва да бъдат IE19760227SEAN#MURPH и IE19511212THOMAMACCO съответно.

5.9.2.2 Вземащият решение е инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат за купувача/продавача

#### Пример 24

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент съгласно неограничен мандат. Следователно, инвестиционен посредник X взема инвестиционното решение от името на своя клиент. Клиентът, Пепе Торес Бланко, е мексикански гражданин с номер на паспорта: MMM23654Z и е роден на 20 май 1968 г.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Пепе Торес Бланко	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; </pre>
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ПЕПЕ'	
10	Купувач - фамилия (и)	'ТОРЕС', 'БЛАНКО'	

11	Купувач - дата на раждане	20.05.1968	<pre> &lt;FrstNm&gt;PEPE&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;TORRES, BLANCO&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1968-05-20&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;MXMMM23654Z&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;DcsnMakr&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt; &lt;/DcsnMakr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
12	Код на вземачия решение за покупка	{LEI} на инвестиционен посредник X	
13	Лице, което взема решението за купуване - собствено (и) име (на)		
14	Лице, което взема решението за купуване - фамилия (и)		
15	Лице, което взема решението за купуване - дата на раждане		

## 5.10 Клетка 3 (комбинация от 1 и 2): Конкретни сценарии за купувача/продавача и вземачия решение

Съгласно предишните клетки, бизнес казусът по-долу показва идентифицирането и допълнителните данни за купувачите, но същият подход важи за продавачите.

### 5.10.1 Купувачът/продавачът е съвместна сметка

#### Пример 25

Инвестиционен посредник X извършва сделка за съвместна сметка с титуляри съпрузите Пиер Дюпон и Мари Дюпон. Пиер Дюпон е френски гражданин и е роден на 27 февруари 1976 г. Неговата съпруга, Мари, е полска гражданка с дата на раждане: 17 януари 1977 г. и национален идентификационен номер (PESEL): 1234567890. Инвестиционното решение е взето от представителя за съвместната сметка, Чарълс Оуен, чиято дата на раждане е: 11 октомври 1968 г. Г-н Оуен е гражданин на Южна Африка (паспорт номер 1111222233334).

Съвместната сметка купува финансовия инструмент.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за купувача?

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на Пиер Дюпон	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;PIERRE&lt;/FrstNm&gt; </pre>
		{NATIONAL_ID} на Мари Дюпон	
9	Купувач - собствено (и) име (на)	'ПИЕР' 'МАРИ'	
10	Купувач - фамилия (и)	'ДЮПОН' 'ДЮПОН'	

11	Купувач - дата на раждане	'27.02.1976' '17.01.1977'	<pre> &lt;Nm&gt;DUPONT&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1976-02-27&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19760227PIERRDUPON&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;MARIE&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;DUPONT&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1977-01-17&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;PL12345678901&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;DcsnMakr&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;CHARLES&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;OWEN&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1968-10-11&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;ZA1111222233334&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/DcsnMakr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
12	Код на вземация решение за покупка	{NATIONAL_ID} на Чарълс Оуен	
13	Лице, което взема решението за купуване - собствено (и) име (на)	'ЧАРЪЛС'	
14	Лице, което взема решението за купуване - фамилия (и)	'ОУЕН'	
15	Лице, което взема решението за купуване - дата на раждане	11.10.1968	

Полета 7-11 трябва да се повтарят за всеки купувач.

Вземаният решение извършва действия за съвместната сметка, не за всяко физическо лице и следователно тя се попълва само веднъж.

### 5.10.2 Продавачът е починал

За сделки, произтичащи от заверено завещание за починали клиенти или наследства, починалото лице следва да бъде отчетено като продавач и то се счита за вземащ решение и следователно полетата за вземания решение не биха били попълнени. Когато страна наследява

финансови инструменти, тя би била отчетена като купувач, а наследяващата страна би била отчетена за вземащ решение и полетата за вземащ решение не се попълват.

## 5.11 Клетка 4: Решението за инвестиция е в рамките на полето „дружество“

### 5.11.1 Решението за инвестиция е в рамките на полето „дружество“

Както е посочено в член 8, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, това поле следва винаги да се попълва, когато инвестиционният посредник търгува за собствена сметка, тъй като той излага своите позиции на риск и следователно се счита, че прави инвестиционно решение. Единственото изключение от това правило е в рамките на контекста на предаване, където инвестиционният посредник се отчита като получаващ инвестиционен посредник и търгуващ за своя сметка, при което той следва, в съответствие с поле 57, да попълни отчета от страна на клиента с информацията, осигурена от предаващия инвестиционен посредник (вж. раздели 5.26.3.1, 5.26.4.1, 5.26.4.2 и 5.27.2).

В допълнение, съгласно член 8, параграф 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, това поле следва също да бъде попълнено, когато инвестиционният посредник взема инвестиционно решение за клиент, който извършва действия съгласно неограничен мандат – (вж. раздел 5.27.1).

#### Пример 26

Инвестиционен посредник X купува финансов инструмент.

Търговец 1 е лице в инвестиционен посредник, което основно отговаря за инвестиционното решение.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва инвестиционното решение в полето дружество?

N	Поле	Стойности	XML представителство
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 1	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;       &lt;Prsn&gt;         &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;         &lt;Othr&gt;           &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;           &lt;SchmeNm&gt;             &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;           &lt;/SchmeNm&gt;         &lt;/Othr&gt;       &lt;/Prsn&gt;     &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Обърнете внимание, че противно на данните на купувача никакви данни не се изискват за определеното лице, което отговаря за инвестиционното решение в рамките на инвестиционното дружество. Единствената изисквана информация е националният идентификатор за физическо лице.

Когато алгоритъм в рамките на инвестиционния посредник отговаря основно за инвестиционното решение, поле 57 се попълва с кода на алгоритъма.

### 5.11.2 Инвестиционно решение, взето извън дружеството (клиентът взема инвестиционното решение и инвестиционният посредник извършва действия на база съответстваща главница или „всяко друго качество“)

#### Пример 27

Инвестиционен посредник X извършва действия в търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки или на база „всяко друго качество“ и купува финансов инструмент за редовен или доверен клиент.

Инвестиционното решение се счита за взето от клиента без значение дали инвестиционен посредник X е препоръчал финансовия инструмент на клиента, тъй като накрая клиентът е взел инвестиционното решение.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва инвестиционното решение в полето дружество?

Тъй като инвестиционен посредник X извършва действия на база „всяко друго качество“ или в търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки, то нито поле 57, нито поле 12 следва да бъдат попълнени.

N	Поле	Стойности	XML представителство
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;FinInstrm&gt;       ...     &lt;/FinInstrm&gt;     &lt;ExctgPrsn&gt;       ...     &lt;/ExctgPrsn&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre> <p>Ако поле не е попълнено, съответният XML елемент (т.е. &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;) не следва да присъства в съобщението</p>

Ако вместо това инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка, въпреки че сделката може да е започната от клиента, инвестиционният посредник X се счита, че е взел инвестиционното решение и следователно поле 57 следва да се попълни, а поле 12 следва да бъде празно.



## 5.12 Клетка 5: Изпълнение в полето дружество

Поле 59 следва да бъде запълнено във всеки отчет за сделка. В случаите, когато решението за изпълнение е взето от клиента (напр. клиентът определя данните за търговията, включително мястото на изпълнение) или от друго лице извън инвестиционния посредник (напр. служител на дружество в рамките на същата група), инвестиционните посредници следва да използват стойността по подразбиране „NORE“ в това поле.

### Пример 28

Инвестиционен посредник X купува финансов инструмент от името на клиент, като данните на сделката са конкретно посочени от този клиент.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва изпълнението в полето дружество?

N	Поле	Стойности	XML представителство
59	Изпълнение в рамките на дружеството	'NORE'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPrsn&gt;       &lt;CInt&gt;NORE&lt;/CInt&gt;     &lt;/ExctgPrsn&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Ако полето е попълнено с код различен от „NORE“, кодът е - както е посочено в член 9 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията - или идентификатора на лице в рамките на инвестиционния посредник или идентификатора на алгоритъм в рамките на инвестиционния посредник, в зависимост кой основно отговаря за изпълнението. Това е отговорност на инвестиционния посредник да определи в съответствие със своя модел на управление.

### 5.12.1 Лицето носи основната отговорност за изпълнението

Когато лице отговаря основно за изпълнението, поле 59 се попълва с националния идентификатор за това лице.

### 5.12.2 Алгоритъмът носи основната отговорност за изпълнението

#### Пример 29

Когато изпълнението е извършено от алгоритъм, алгоритъмът следва да бъде докладван в поле 59 на таблица 2 в Приложение I на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Инвестиционен посредник X купува финансов инструмент и алгоритъмът на инвестиционния посредник X (код: 4567EFZ) отговаря за изпълнението на тази сделка.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва изпълнението в полето дружество?

N	Поле	Стойности	XML представителство
---	------	-----------	----------------------

59	Изпълнение в рамките на дружеството	{Код на алгоритъма}	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPrsn&gt;       &lt;Algo&gt;4567EFZ&lt;/Algo&gt;     &lt;/ExctgPrsn&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
----	-------------------------------------	---------------------	--

Терминът „алгоритъм“ следва да се разбира като всяка система, която автоматично изпълнява сделки без човешка намеса. Също така в този случай идентификатор за автоматизирана система следва да бъде попълнен.

### 5.13 Клетка 6: Дата и време на търгуване

Датата и времето за търгуване, които следва да бъдат отчетени, следва да бъдат момента във времето, в който сделката възниква и страните са ангажирани със сделката, а не датата и времето на всяко последващо потвърждение.

Когато инвестиционен посредник изпрати поръчка до дружество извън ЕИП, което изпълнява поръчката, инвестиционният посредник следва да положи максимални усилия да получи най-точната дата и време.

За поле 28 дата и време на търгуване, стойностите не следва да бъдат закръглявани и нивото на детайлност следва да бъде в съответствие с изискванията, посочени в поле 28 на таблица 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Относно информация за изискванията за ниво на детайлност в отчетите за сделки, прочетете раздел 7.2 относно нивото на детайлност на удостоверенията за време.

### 5.14 Клетка 7: Място на провеждане

Примерите в тази клетка обхващат попълването на поле място и другите значими полета за пряка сделка на пазара. Следва да бъде отчетено, че както е обяснено в раздел 5.4.2 относно „Отчитане на полето място за вериги“ единствено прякото изпълнение на място за търговия<sup>28</sup> или платформа за търговия или систематичен участник следва да бъдат идентифицирани като съществуващи на мястото. Относно примери за попълване на полето „място“ в други ситуации вижте 5.22 - 5.24 и 5.26 - 5.27 (сценарии, свързани с множество изпълнения, групиране на поръчки, организирани системи за търговия, които извършват действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ и изпълнение чрез верига от инвестиционни посредници, предаване и инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат).

Информация как да отчитате сделки с определени финансови инструменти е посочена в част IV.

<sup>28</sup> Включително примери, където сделките договорени извън мястото на търговия, са подчинени на правилата на това място на търговия.

### 5.14.1 Изпълнение на сделка на място на търговия в анонимен регистър с поръчки

#### Пример 30

Инвестиционен посредник X продава финансов инструмент на място за търговия. Сделката беше изпълнена на 5 май 2018 г. в 09:10:33.124373 ч. Мястото на търговия генерира идентификационен код на сделка за място на търговия (TVTIC) (ABCDEFG123456).

а) място на търговия М (което използва централен контрагент)

б) място на търговия Б не използва централен контрагент и самоличността на придобиващата /продаващата страна не е оповестена в момента на изпълнение. Неговият сегмент MIC е 'XABC'.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва полето място и свързаните полета?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'ABCDEFG123456'	'ABCDEFG123456'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия Б
28	Дата и време на търгуване	'05.05.2018 г., 09:10:33.124 ч.'	'05.05.2018 г., 09:10:33.124 ч.'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия Б

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-05-05T09:10:33.124Z&lt;/TradDt&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;      &lt;TradPlcMtchgId&gt;ABCDEFG123456&lt;/TradPlcMtchgId&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;MIC&gt;XABC&lt;/MIC&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-05-05T09:10:33.124Z&lt;/TradDt&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XABC&lt;/TradVn&gt; </pre>

<pre> &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradPlcMchglId&gt;ABCDEF123456&lt;/TradPlcM tchglId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---

### 5.14.2 Изпълнение на сделка на платформа за търговия извън Съюза в неанонимен регистър с поръчки

#### Пример 31

Инвестиционен посредник X продава отчетен финансов инструмент на организирана платформа за търговия извън Съюза (MIC: XAAA) като улучва поръчка за покупка на инвестиционен посредник Y. Сделката е изпълнена на 10 септември 2018 г. в 13:15:45.122469 ч.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва полето място и свързаните полета?

N	Поле	Стойности	XML представителство
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия		<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... </pre>
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<pre> &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; &gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; </pre>
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	
28	Дата и време на търгуване	'10.09.2018 г., 13:15:45 ч.'	
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на платформа за търговия	<pre> ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09-10T13:15:45Z&lt;/TradDt&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;XAAA&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Идентификационният код на сделка на място на търговия не важи за този случай, защото сделката не е изпълнена на място на търговия.

Инвестиционен посредник X познава контрагента на пазара (инвестиционен посредник Y) и следователно контрагентът на пазара е идентифициран в отчета за сделка, в този случай като купувача.

Тъй като сделката не се случва на място на търговия, нивото на детайлност, отчетено за времето, следва да бъде секунди или по-добро.

### 5.14.3 Изпълнение на сделка на място на търговия като улучва своя собствена поръчка в анонимен регистър с поръчки

Както е отбелязано в раздел 5.6 „Значение на понятието „сделка““ в част I това е случая, в който разпоредбата в член 2, параграф 4 е предвидена да се прилага.

#### Пример 32

Инвестиционен посредник X, който извършва действия за собствена сметка, улучва своя собствена поръчка на място на търговия M, което генерира идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC) (ABCDEFG123456) за тази сделка, изпълнена на 15 юли 2018 г. в 11:37:22.867415 ч.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва полето място и свързаните полета?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'ABCDEFG123456'	'ABCDEFG123456'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M
28	Дата и време на търгуване	'15.07.2018 г., 11:37:22.867 ч.'	'15.07.2018 г., 11:37:22.867 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	Сегмент {MIC} на място на търговия M

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...

<pre> &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty &gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-07-15T11:37:22.867Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XABC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;TradPlcMtchglD&gt;ABCDEFGH123456&lt;/TradPlcM tchglD&gt;   &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty &gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-07-15T11:37:22.867Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XABC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;TradPlcMtchglD&gt;ABCDEFGH123456&lt;/TradPlcM tchglD&gt;   &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--

#### 5.14.4 Систематичен участник осъществява сделка

##### Пример 33

Инвестиционен посредник Y желае да продава акции. Инвестиционен посредник X, извършващ действия като систематичен участник (СУ), купува акции от инвестиционен посредник Y. Сделката е извършена на 15 юли 2018 г., в 11:37:22 ч.

Сегмент MIC на SI е SMIC.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Стойности на доклад Инвестиционен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
28	Дата и време на търгуване	'15.07.2018 г., 11:37:22 ч.'	'15.07.2018 г., 11:37:22 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на SI (инвестиционен посредник X)	Сегмент {MIC} на SI (инвестиционен посредник X)

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07-15T11:37:22.Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;SMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/Exc tgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07- 15T11:37:22.Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;SMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

## 5.15 Клетка 8: Флаг за къса продажба

Бизнес казусите по-долу се прилагат при обстоятелства, при които инвестиционният посредник извършва къса продажба на <sup>29</sup> подлежащи на отчитане акции или държавен дълг в обхвата на членове 12, 13 и 17 от Регламент (ЕС) № 236/2012, или за собствена сметка или от името на клиент. Инвестиционният посредник следва да поиска клиента да оповести дали той извършва къса продажба.

Когато информацията за къса продажба не е предоставена на инвестиционния посредник от клиента, поле 62 следва да се попълни с 'UNDI'.

Флагът за къса продажба се прилага за отчети, които показват сделки с клиенти физически лица, а не обобщен отчет за пазарна сделка. Следователно, когато двамата клиента или един от клиентите извършва къса продажба, показателят за къса продажба следва да бъде празен в обобщения отчет за пазарна сделка, тъй като този отчет не е свързан с един клиент, а вместо това с всички клиенти, чиито поръчки са обобщени.

За информация къде се извършва обобщаването и как се прилага флагът за къса продажба вижте раздели 5.23, 5.24 и 5.27.2.

### 5.15.1 Клиент на инвестиционен посредник X извършва къса продажба (информация, известна на дружество X)

#### Пример 34

Инвестиционен посредник X продава акции от името на клиент А. Клиент А осъществява къса продажба.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за къса продажба?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на клиент А	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
18	Продавач - собствено(и) име(на)		<Sellr> <AcctOwnr> <Id>
19	Продавач - фамилия (и)		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id>
20	Продавач - дата на раждане		</AcctOwnr> </Sellr>
62	Показател за къса продажба	'SESH'	... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

<sup>29</sup> Съгласно определението в член 2, параграф 1, буква б) от Регламент (ЕС) № 2346/2012.



## 5.15.2 Инвестиционен посредник X осъществява къса продажба от свое име

### Пример 35

Инвестиционен посредник X продава държавен дълг от свое име.

#### 5.15.2.1 Сделката се осъществява по изключение

Сделката се осъществява съгласно изключението за поддържане на пазара или изключението за първичен пазар, предвидени в член 17 от Регламент (ЕС) № 236/2012.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за къса продажба?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       ...     &lt;/Tx&gt;     ...     &lt;AddtlAttrbts&gt;       &lt;ShrtSellgInd&gt;SSEX&lt;/ShrtSellgInd&gt;       ...     &lt;/AddtlAttrbts&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	
62	Показател за къса продажба	'SSEX'	

#### 5.15.2.2 Сделката не се осъществява като изключение

Сделката не се осъществява съгласно изключението за поддържане на пазара или изключението за първичен пазар, предвидени в член 17 от Регламент (ЕС) № 236/2012.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва информацията за къса продажба?

N	Поле	Стойности	XML представителство
---	------	-----------	----------------------

4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...
62	Показател за къса продажба	'SESH'	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

## 5.16 Клетка 9: Показатели за отказ, извънборсови показатели след сделката и показатели за стоков дериват

### 5.16.1 Показател за отказ и извънборсов показател след сделката

Поле 61 следва да бъде попълнено от инвестиционния посредник, който е подал поръчката до мястото на търговия или е направил отчет за сделката до мястото на търговия.

Инвестиционен посредник следва да не попълва поле 63 с извънборсов показател след сделка 'CANC', тъй като задължението за осигуряване на извънборсови показатели след сделка съгласно член 26, параграф 3 предполага съществуването на сделка за целите на член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти, както е определено в член 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията и отмяната не се счита за сделка за целите на член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

#### 5.16.1.1 Сделка, извършена на място на търговия

##### Пример 36

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка за клиент като търгува за собствена сметка. Инструментът е капиталов инструмент. Инвестиционен посредник X купува финансовия инструмент на място на търговия M и след това го продава на клиента.

Купуването на място на търговия се осъществява съгласно освобождаването от изискванията за „сделка с референтна цена“ в съответствие с член 4 от Регламента за пазарите на финансови инструменти. Продажбата на клиента е „голяма по размер“ в съответствие с член 20, параграф 3, буква а) от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

Тъй като пазарната страна на сделката е изпълнена на място на търговия, инвестиционен посредник X следва да отчита полето за показателя за отказ. Инвестиционен посредник X трябва също да отчита извънборсовия показател след сделката от страна на клиента в сделката.

Как следва инвестиционен посредник X да отчита показателите за отказ и извънборсовите показатели след сделката?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'
61	Показател за освобождаване от задължения	'RFPT'	
63	Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката		'LRGS'

XML представителство:

Доклад #1 (доклад от гледна точка на пазара)	Доклад #2 (доклад от гледна точка на клиента)
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...     &lt;AddtlAttrbts&gt;       &lt;Wvrlnd&gt;RFPT&lt;/Wvrlnd&gt;     &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;/New&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;     &lt;OTCPstTradInd&gt;LRGS&lt;/OTCPstTradInd&gt;   &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

#### 5.16.1.2 Сделка, извършена на извънборсов пазар

##### Пример 37

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка с инвестиционен посредник Y извънборсово с капиталов инструмент. Инвестиционни посредници X и Y търгуват за собствена сметка Сделката е с размер, който отговаря на изискванията за широкомащабна сделка.

Тъй като сделката е изпълнена извънборсово, единствено полето за извънборсовия показател след сделката е приложимо.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Стойности на доклад Инвестиционен посредник Y
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'
61	Показател за освобождаване от задължения		
63	Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката	'LRGS'	'LRGS'

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;     ...     &lt;OTCPstTradInd&gt;LRGS&lt;/OTCPstTradInd&gt;     ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;     ...     &lt;OTCPstTradInd&gt;LRGS&lt;/OTCPstTradInd&gt;     ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

### 5.16.1.3 Сделка изпълнена извън регистъра с поръчки, но съгласно правилата на място на търговия

#### Пример 38

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка от името на клиент А като купува капиталов инструмент от дружество Ш. Сделката се случва извън регистъра с поръчки, но съгласно правилата на място на търговия М. Сделката е изпълнена съгласно отказа, свързан с „договорени сделки в неликвидни финансови инструменти“ в съответствие с член 4, параграф 1, буква б), подточка ii) на Регламента за пазарите на финансови инструменти.

Инвестиционен посредник Y е член на място на търговия и е направил отчет за сделка до мястото на търговия, което след това е направило публикуването за прозрачност след сделката за нея.

Инвестиционен посредник Y и клиент А извършват действия за собствена сметка.

Инвестиционен посредник Y следва да попълни показателя за отказ в отчета за сделка, тъй като той е направил отчета за сделка до мястото на търговия и инвестиционен посредник X може също да попълни показателя за отказ, ако разполага с информацията.

Тъй като сделката между X и Y се е случила съгласно правилата на мястото на търговия, извънборсовият показател след сделка не е попълнен в техните отчети понеже това е единствено приложимо за сделки, които не са извършени на място на търговия.

Клиент А следва да не попълва показателя за отказ, тъй като той не отчита пазарната страна на сделка на място на търговия. Извънборсовият показател след сделката не следва да се попълва при каквито и да е обстоятелства от клиент А, тъй като това не е отделна извънборсова сделка, а „крак“ на клиента, който е свързан с изпълнение на пазара, т.е. е част от верига.

Как следва инвестиционни посредници X и Y и клиент А да се отчитат като се допусне, че клиент А е инвестиционно дружество?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Стойности на доклад Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности клиент А
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на клиент А
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент А
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'	'DEAL'

36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'
61	Показател за освобождаване от задължения		'OILQ'	
63	Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката			

XML представителство:

Доклад на Инвестиционен посредник X	Доклад на Инвестиционен посредник Y	Доклад на клиент A
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234     567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Buyr&gt;         &lt;AcctOwnr&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAA             AAAAA&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;             ...             &lt;/AcctOwnr&gt;           &lt;/Buyr&gt;           &lt;Sellr&gt;             &lt;AcctOwnr&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNO                 PQRST&lt;/LEI&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;               &lt;/Sellr&gt;             ...             &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/Tradg             Cpcty&gt;             ...             &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;             ...             &lt;/Tx&gt;           ...           &lt;/New&gt;         &lt;/Tx&gt;       </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMN     OPQRST&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Buyr&gt;         &lt;AcctOwnr&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/L             EI&gt;             &lt;/Id&gt;             ...             &lt;/AcctOwnr&gt;           &lt;/Buyr&gt;           &lt;Sellr&gt;             &lt;AcctOwnr&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN                 OPQRST                 T&lt;/LEI&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;               &lt;/Sellr&gt;             ...             &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;             ...             &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;             ...             &lt;/Tx&gt;           ...           &lt;AddtlAttrbts&gt;             &lt;Wvrlnd&gt;OILQ&lt;/Wvrlnd&gt;             ...             &lt;/AddtlAttrbts&gt;           &lt;/New&gt;         &lt;/Tx&gt;       </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;AAAAAAAAAAAA     AAAAAAAAA&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Buyr&gt;         &lt;AcctOwnr&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAA             AAAAA&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;             ...             &lt;/AcctOwnr&gt;           &lt;/Buyr&gt;           &lt;Sellr&gt;             &lt;AcctOwnr&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;123456789012345678                 90&lt;/LEI&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;               &lt;/Sellr&gt;             ...             &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/Tradg             Cpcty&gt;             ...             &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;             ...             &lt;/Tx&gt;           ...           &lt;/New&gt;         &lt;/Tx&gt;       </pre>

	</Tx>	
--	-------	--

5.16.2 Показател след сделка, където инвестиционен посредник съчетава две клиентски поръчки извънборсово

Прочетете раздел 5.20.

### 5.16.3 Показател за стокови деривати

5.16.3.1 Когато клиентът е посочил, че намалява своя риск

#### Пример 39

Инвестиционен посредник X е изпълнил сделка от името на клиент, клиент 3, който не е финансов субект, в стоков дериват, както е определено в член 2, параграф 1, точка 30 на Регламента за пазарите на финансови инструменти, където клиент 3 е посочил, че намалява своя риск по обективно измерим начин в съответствие с член 57 от Директива 2014/65/ЕС. Инвестиционен посредник X действа във „всяко друго качество“.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва показателя за стоков дериват?

N	Поле	Стойности на доклад Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности клиент А
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
64	Показател за стокови деривати	'true'	'true'

Ако клиент 3 не е посочил на инвестиционен посредник X, че той намалява своя риск по обективно измерим начин в съответствие с член 57 от Директива 2014/65/ЕС инвестиционен посредник X следва да попълни поле 64 с „false“.

5.16.3.2 Когато инструментът не е стоков дериват

#### Пример 40

Инвестиционен посредник X е изпълнил сделка от името на клиент 3 с инструмент, който не е стоков дериват съгласно член 2, параграф 1, точка 30 от Регламент (ЕС) № 600/2014.

Как инвестиционен посредник X следва да докладва показателя за стоков дериват?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности клиент А
---	------	---	----------------------------------

29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
64	Показател за стокови деривати		

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад на клиент А
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Тъй като инструментът не е стоков дериват съгласно член 2, параграф 1, точка 30 от Регламента за пазарите на финансови инструменти, поле 64 не е приложимо и не следва да се попълва.

## 5.17 Клетка 10: Клонове

### 5.17.1 Сделка, извършена от името на клиент

#### Пример 41

Холандски инвестиционен посредник, инвестиционен посредник Г, има LEI: 13579135790246802468. Той има клонове в Париж (FR), Лондон (GB) и Франкфурт (DE). Той получава поръчка от испански клиент, клиент Д, чрез своя търговец 7 за закупуване на определен финансов инструмент. Клиент Д има LEI: 24242424242424242424,. Клиентът изпраща нареждането до клона в Париж. Клонът в Париж изпраща поръчката до търговския отдел в Лондон. Търговец 8, надзираван от лондонския клон, решава да изпълни поръчката на място на търговия М. Търговец 7 е френски гражданин, Жан Бернард, с дата на раждане: 4 май 1972 г. Търговец 8 е британски гражданин с номер на британска национална застраховка: QQ123456С. Членството на мястото на търговия М се държи от клона във Франкфурт<sup>30</sup>.

Докладът за сделката е подаден на АБЧ (NL).

Как инвестиционно дружество Г и клиент Д следва да отчетат полетата за клона, като се допуска че клиент Д има задължения за отчитане на сделки и търгува за собствена сметка?

4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на дружество Г	{LEI} на клиент Д

<sup>30</sup> В някои юрисдикции е възможно и в някои случаи дори нормалната процедура за (местен) клон да държи членството на пазара.



7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент Д	{LEI} на клиент Д
8	Държава на клона на купувача.	FR	
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на дружество Г
17	Държава на клона на продавача.		
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'
37	Държава на членство на клона	'DE'	
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		{NATIONAL_ID} на 'търговец 7'
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение		'ES'
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на 'търговец 8'	{NATIONAL_ID} на 'търговец 7'
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'GB'	'ES'

XML представителство:

Доклад от дружество Г	Доклад на клиент Д
<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;13579135790246802468&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;242424242424242424&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;FR&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;111111111111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;DE&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;242424242424242424&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;242424242424242424&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;13579135790246802468&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt; </pre>

<pre> &lt;Othr&gt;   &lt;Id&gt;QQ123456C &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Othr&gt;   &lt;Id&gt;FR19720504JEAN#BERNA&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;Id&gt;FR19720504JEAN#BERNA&lt;/Id&gt;     &lt;SchmeNm&gt;       &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;     &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--

Поле 17 не е попълнено от инвестиционен посредник Г или клиент Д, защото това поле се попълва единствено, ако полето на продавач се попълва с клиент на изпълняващия инвестиционен посредник. По подобен начин, поле 8 не се попълва в отчета за сделка на клиент Д, защото клиент Д няма основен клиент, попълнен в поле 7.

Поле 57 е празно в отчета на инвестиционен посредник D, тъй като инвестиционен посредник D извършва действия във „всяко друго качество“. Поле 58 не трябва да бъде попълвано в отчета на инвестиционен посредник D, защото поле 57 е празно.

Поле 58 е попълнено от клиента с кода на държавата за централата на клиент Д (ES), тъй като никакъв клон не участва.

### 5.17.2 Сделка, извършена за собствена сметка

#### Пример 42

Търговец 7, надзираван от централата на испански инвестиционен посредник Д, с LEI: 12312312312312312312, който има клонове в Париж (Франция), Лондон (Великобритания) и Франкфурт (Германия) решава да продаде определен финансов инструмент. Търговец 7 решава да изпълни поръчката на място на търговия М. Членството в място на търговия М се държи от клона във Франкфурт.

Докладът за сделката е подаден на CNMV (Испания).

Как инвестиционно дружество Д следва да докладва полетата за клон?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на дружество Д	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... </pre>

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	<pre> &lt;ExctgPty&gt;12312312312312312312312312&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;1111111111111111111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12312312312312312312312312&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;DE&lt;/CtryOfBrnch&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;FR19720504JEAN#BERNA &lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;FR19720504JEAN#BERNA &lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
8	Държава на клона на купувача.		
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на дружество Д	
17	Държава на клона на продавача.		
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	
37	Държава на членство на клона	'DE'	
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 7	
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение	'ES'	
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 7	
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'ES'	

Поле 17 е празно тъй като това поле е единствено запълнено, когато продавачът е запълнен с клиент.

### 5.17.3 Сделка, изпълнена от клонове от ЕИП на дружества извън ЕИП

#### Пример 43

Търговец, надзираван от централа на американско дружество, дружество Е с LEI: 222222222222222222 с клонове в Париж (Франция), Лондон (Великобритания) и Франкфурт (Германия) решава да купи определен финансов инструмент. Сделката е изпълнена на място на търговия М от търговеца. Членството на мястото на търговия М се държи от клона във Франкфурт. Дружеството търгува за собствена сметка.

Как дружество Е следва да докладва полетата за клон?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционно дружество Е	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционно дружество Е	<ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> ...
8	Държава на клона на купувача.		<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>22222222222222222222</LEI> </Id>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
17	Държава на клона на продавача.		<Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	</AcctOwnr> </Sellr> ...
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	<Tx> ...
37	Държава на членство на клона	'DE'	<TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ...
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение	„САЩ“	<TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx>
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	„САЩ“	... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </ExctgPrsn> ...

			</New> </Tx>
--	--	--	-----------------

Полета 8 и 17 (държава на клона за купувача и продавача) са празни, тъй като тези полета се попълват единствено, когато купувачът или продавачът са запълнени с клиенти.

За отчитане на сделки, решение относно компетентния орган, до който отчетът за сделка е подаден, трябва да бъде взето предварително. Този компетентен орган не трябва да бъде компетентен орган, който е разрешил клоновете, участващи в тази сделка, но трябва да бъде един от компетентните органи, който е разрешил клон на дружество в съответствие със съвместния подбор от дружество от третата страна съгласно член 14 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. В примера по-горе, отчетът за сделка може да бъде подаден до компетентните органи на Великобритания, Франция или Германия.

Съгласно Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, когато клон от ЕИП на дружество извън ЕИП извърши каквато и да е дейност, посочена в член 3, този клон извършва сделка и трябва да отчети сделка. В този пример, германският клон изпълнява сделка тъй като той търгува на пазара и следователно отчетът за сделка на дружество Е се попълва както е показано по-горе.

## 5.18 Клетка 11: Статус на отчетите за сделка и корекциите

Статусът на 'NEWT' в поле 1 се използва за сделка, която все още не е отчетена и за коригиране на неточен отчет за сделка след отмяна на първоначалния отчет за сделка.

Статусът на 'CANC' се използва за отмяна на отчети за сделки в неподлежащи на отчитане сделки и за отмяна на отчети за сделки, които съдържат грешки преди изготвянето на заместващ отчет за сделка.

Референтните номера на сделки (TRN) следва да бъдат уникални за изпълняващия инвестиционен посредник за всеки отчет за сделка. В случаите когато един или повече одобрени механизми за докладване участват, референтният номер на сделката следва винаги да бъде генериран на равнище изпълняващ инвестиционен посредник. TRN не следва да се използва повторно, освен когато първоначалният отчет за сделката е коригиран или отменен, при което същият референтен номер на сделка следва да се използва за заместващия отчет, както за първоначалния отчет, който се замества (вж. раздели 5.18.3 и 5.18.4). TRN следва да се използва повторно за всяка последваща корекция на същия отчет за сделка. Може да се случи да бъдат налице повече от един запис (нов или отмяна), свързани със същата сделка (със същия референтен номер на сделка и идентификационен код на изпълняващия субект), които следва да бъдат включени в един файл. В този случай, поръчката за данни във файла трябва да следва логиката за обработка на данни, т.е. че (i) можете единствено да отмените сделка, която е отчетена като нова сделка преди и все още не е отменена и (ii) можете единствено да подадете сделка със същата идентификация (същия референтен номер на сделка и идентификационен код на изпълняващия субект), ако предишният отчет за тази сделка е отменен. По-специално, следните случаи трябва да бъдат отчетени:

- а) Нова сделка е отчетена и отменена незабавно (двата отчета са подадени в същия файл) - >отчетът за новата сделка следва да бъде включен във файла преди отчета за отмяната;

- б) сделка, която е била отчетена в един от предишните файлове, е отменена и нов вариант на този преход е подаден в същото време (отмяна на предишния отчет и нов вариант са подадени в същия файл) ->отмяна на предишен отчет за сделка следва да бъде включена във файла преди новия отчет за сделка (нов вариант на сделката);
- в) комбинации от гореспоменатите обстоятелства (т.е. повече от един нов вариант или данни за отмяната, свързани с една сделка) ->в зависимост от обстоятелствата (а) или б) по-горе) първите данни, включени във файла, следва да бъдат или нови или отмяна и следните данни трябва да бъдат поръчани, така че всички данни да бъдат последвани от данни от противоположния тип.

### 5.18.1 Отменени сделки и изменения в рамките на деня

Когато инвестиционният посредник извършва публикуване на сделка след нейното сключване и отменя публикуването на сделка след сключването ѝ преди какъвто и да е отчет за сделка да бъде изготвен, то никакъв отчет за сделка не се изисква да бъде изготвен.

Когато инвестиционен посредник извършва публикуване на сделка след нейното сключване, която е променена преди какъвто и да е отчет за сделка да бъде изготвен, отчетите за сделки следва единствено да отразяват информацията за последното публикуване след сключването на сделката.

### 5.18.2 Подаване на доклад за нова сделка

#### Пример 44

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка извънборсово на 10 март 2018 г. в 12:45:30 ч. Докладът за сделка се подава чрез ARM, ARM 1 (LEI на ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1). Референтният номер на сделката е ETYRU9753.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности Първоначален доклад	XML представителство
1	Статус на отчета	'NEWT'	<Tx>
2	Референтен номер на транзакция	'ETYRU9753'	<New> <TxId>ETYRU9753</TxId>
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на ARM 1	... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty>
28	Дата и време на търгуване	'10.03.2018 г., 12:45:30 ч.'	... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> </Tx>
			... </New> </Tx>

			Обърнете внимание, че поле 1 не съществува в съобщението като XML елемент. Таг New или Cxl таг се използват вместо това.
--	--	--	--

### 5.18.3 Изпращане на уведомление за анулиране

#### Пример 45

Инвестиционен посредник X подава нов отчет за сделка (информация съгласно раздел 5.18.2) като използва одобрен механизъм за докладване 1 (LEI: ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1) и впоследствие отменя отчета за сделка.

Следва да бъде отбелязано, че анулирането може да бъде извършено от различен подаващ субект от подалия първоначалния отчет. Например инвестиционен посредник може да е използвал един одобрен механизъм за докладване за подаване на първоначален отчет и може да отмени самия отчет или да използва друг одобрен механизъм за докладване.

За отмяна единствено ключови полета 1, 2, 4 и 6 следва да бъдат попълнени. Дружествата не могат да изпращат повторно пълния отчет. Ако отчетът за сделка бъде изпратен повторно с повече полета в допълнение към ключовите полета, той ще бъде отхвърлен.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Първоначален отчет със стойности	Отчет за отмяна със стойности
1	Статус на отчета	'NEWT'	'CANC'
2	Референтен номер на транзакция	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на ARM 1	{LEI} на ARM 1

XML представителство:

Първоначален доклад	Доклад за анулиране
<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;ETYRU9753&lt;/TxId&gt;      &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;SubmitgPty&gt;ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1   &lt;/SubmitgPty&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt;</pre> <p>Обърнете внимание, че поле 1 не съществува в съобщението като XML</p>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;Cxl&gt;     &lt;TxId&gt;ETYRU9753&lt;/TxId&gt;      &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;SubmitgPty&gt;ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1&lt;/SubmitgPty&gt;   &lt;/Cxl&gt; &lt;/Tx&gt;</pre> <p>Обърнете внимание, че поле 1 не съществува в съобщението като XML елемент. Таг New или Cxl таг се използват вместо това.</p>

елемент. Таг New или Cxl таг се използват вместо това.

#### 5.18.4 Коригиране на информация в отчет за сделка

За коригиране на информация в отчет за сделка първоначалният отчет трябва да бъде анулиран, а нов отчет да бъде подаден.

За отмяна единствено ключови полета 1, 2, 4 и 6 следва да бъдат попълнени. Отчет за сделка за отмяна, който съдържа други полета освен тези четири полета, ще бъде отхвърлен.

Заместващият отчет следва да има всички полета, които са приложими за отчетената сделка.

##### Пример 46

Инвестиционният посредник X е изпълнил сделката в 5.18.2 с цена от 5 GBP, но сделката отчита цената в малки, а не в големи валутни единици (пени, а не лири).

Отчетът за сделка е отменен на следващия ден в 14:50:20 ч. и заместващ отчет е подаден в същото време за коригиране на цената.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Първоначален отчет със стойности	Отчет за отмяна със стойности	Заместващ отчет със стойности
1	Статус на отчета	'NEWT'	'CANC'	'NEWT'
2	Референтен номер на транзакция	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на ARM 1	{LEI} на ARM 1	{LEI} на ARM 1
28	Дата и време на търгуване	'10.03.2018 г., 12:45:30 ч.'		'10.03.2018 г., 12:45:30 ч.'
33	Цена	'500'		'5'

XML представителство:

Първоначален доклад	Доклад за анулиране	Доклад за подмяна
<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;ETYRU9753&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;Cxl&gt;     &lt;TxId&gt;ETYRU9753&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;ETYRU9753&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...</pre>



<pre> &lt;SubmitgPty&gt;ARM1ARM1ARM 1ARM1ARM1&lt;/SubmitgPty&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-03- 10T12:45:30Z&lt;/TradDt&gt; ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;500&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;SubmitgPty&gt;ARM1ARM1ARM 1ARM1ARM1&lt;/SubmitgPty&gt;   &lt;/Cxl&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;SubmitgPty&gt;ARM1ARM1A RM1ARM1ARM1&lt;/Submitg Pty&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-03- 10T12:45:30Z&lt;/TradDt&gt; ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	---

Обърнете внимание, че датата и времето следва да бъдат датата и времето на първоначалната сделка, т.е. 10.03.2018 г. в 12:45:30 ч., а не датата и времето на коригиращия отчет. Обърнете също внимание, че както при настоящите насоки, първоначалните и заместващи отчети трябва да съдържат всички други данни, които са от значение за сделката и примерите по-горе единствено предоставят извлечения от отчетите.

## 5.19 Клетка 12: Условна промяна

### 5.19.1 Условно увеличение

#### Пример 47

Инвестиционен посредник X продава защита на инвестиционен посредник Y на 26 октомври 2018 г. в 08:21:01 ч. за 2 млн. евро в суап за кредитно неизпълнение. Суапът за кредитно неизпълнение има фиксиран купон от 100 базисни точки и авансово плащане от 50000 EUR, получено от инвестиционен посредник X. Инвестиционен посредник X и дружество Ш извършват действия за собствена сметка.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y
2	Референтен номер на транзакция	'12456771'	'39998776'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y

16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'26.10.2018 г., 08:21:01 ч.'	'26.10.2018 г., 08:21:01 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'2000000'	'2000000'
32	Условно увеличение/намаление на дериват		
33	Цена	'100'	'100'
38	Авансово плащане	'50000'	'50000'

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;12456771&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-10-26T08:21:01Z&lt;/TradDt&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     ...     &lt;UpFrntPmt&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;50000&lt;/Amt&gt;     &lt;/UpFrntPmt&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;39998776&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/E xctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-10- 26T08:21:01Z&lt;/TradDt&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     ...     &lt;UpFrntPmt&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;50000&lt;/Amt&gt; </pre>

<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/UpFrntPmt&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---------------------------------------	--

Обърнете внимание, че авансовото плащане (поле 38) следва да показва положителна стойност в отчета за сделка на инвестиционен посредник X и дружество Ш, дружеството закупило защита, тъй като продавачът на суапа за кредитно неизпълнение получава сумата.

На 25 ноември 2018 г. в 10:52:03 ч. страните по договора за суап за кредитно неизпълнение по-горе се съгласяват да увеличат условната сума на 5 млн. евро и определят допълнително плащане, получено от инвестиционен посредник X в размер на 75000 EUR. Купоновите плащания остават непроменени.

Как трябва да докладват условното увеличение инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Стойности на доклад Инвестиционен посредник Y
2	Референтен номер на транзакция	'124567981'	'399987981'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'25.11.2018 г., 10:52:03 ч.'	'25.11.2018 г., 10:52:03 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'3000000'	'3000000'
32	Условно увеличение/намаление на дериват	'УВЕЛ'	'УВЕЛ'
33	Цена	'100'	'100'
38	Авансово плащане	'75000'	'75000'

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;124567981&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;399987981&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/E xctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; </pre>

<pre> &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-11-25T10:52:03Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;3000000&lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;DerivNtnlChng&gt;INCR&lt;/DerivNtnlChng&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   ...   &lt;UpFrntPmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;75000&lt;/Amt&gt;   &lt;/UpFrntPmt&gt;   ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-11- 25T10:52:03Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;3000000&lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;DerivNtnlChng&gt;INCR&lt;/DerivNtnlChng&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   ...   &lt;UpFrntPmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;75000&lt;/Amt&gt;   &lt;/UpFrntPmt&gt;   ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

Референтният номер на сделка (поле 2) за този отчет за сделка е уникален за увеличението, а не е същия както за първоначалния отчет за сделката.

Количеството (поле 30) е сумата на условното увеличение. Когато е налице промяна в купонните плащания след промяна в условната сума, новият купон следва да бъде показан в полето цена (поле 33).

Обърнете внимание, че датата и времето са датата и времето на увеличението, а не датата и времето на първоначалната сделка.

Първоначалният доклад за сделката не следва да бъде отменен.

Отчетът на първоначалната сделка и този за увеличението в условната сума заедно посочват, че инвестиционен посредник X е продал защита на своя контрагент за 5 млн. евро.

## 5.19.2 Условно намаление

### 5.19.2.1 Частично предсрочно прекратяване

#### Пример 48

Както в предходния пример, но вместо увеличаване на условната сума на 25 ноември 2018 г. в 10:52:03 ч., страните са съгласни да намалят условната сума с 0,5 млн. до 1,5 млн. евро с плащане на 37500 EUR от инвестиционен посредник X за намалението.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности инвестиционен посредник X	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y
2	Референтен номер на транзакция	'124567852'	'39998792'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
28	Дата и време на търгуване	'25.11.2018 г., 10:52:03 ч.'	'25.11.2018 г., 10:52:03 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'500000'	'500000'
32	Условно увеличение/намаление на дериват	'НАМАЛ'	'НАМАЛ'
33	Цена	'100'	'100'
38	Авансово плащане	'37500'	'37500'

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;124567852&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;39998792&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>

<pre> &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-11-25T10:52:03Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;500000&lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;DerivNtnlChng&gt;DECR&lt;/DerivNtnlChng&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;UpFrntPmt&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;37500&lt;/Amt&gt; &lt;/UpFrntPmt&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNORST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; ...   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-11- 25T10:52:03Z&lt;/TradDt&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;MntryVal Ccy="EUR"&gt;500000&lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;DerivNtnlChng&gt;DECR&lt;/DerivNtnlChng&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;BsisPts&gt;100&lt;/BsisPts&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt; ...     &lt;UpFrntPmt&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;37500&lt;/Amt&gt;     &lt;/UpFrntPmt&gt;   &lt;/Tx&gt; ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--

Авансовото плащане е положително в двата отчета, тъй като въпреки че инвестиционен посредник X сега заплаща, а не получава плащането, продавачът в този отчет е Y и така продавачът получава плащането.

Тъй като експозицията се намалява и инвестиционен посредник X първоначално продава, инвестиционен посредник X сега купува.

Количеството (поле 30) е сумата на условното намаление. Когато е налице промяна в купонните плащания след промяна в условната сума, новият купон следва да бъде показан в полето цена (поле 33).

Обърнете внимание, че датата и времето са датата и времето на намалението, а не датата и времето на първоначалната сделка.

Отчетът на първоначалната сделка и този за намалението в условната сума заедно посочват, че инвестиционен посредник X е продал защита за 1,5 млн. евро. Първоначалният доклад не следва да бъде отменен.

### 5.19.3 Пълно предсрочно прекратяване

Ако страните се съгласят на пълно предсрочно прекратяване на договора, то условната сума би била намалена с пълната сума на първоначалния договор.

## Част III – Сценарии за търговия

### 5.20 Прехвърляне на ценни книжа

#### 5.20.1 Прехвърляне между клиентите в рамките на едно и също дружество

Както беше отбелязано в част I, когато собствеността на основния клиент не се променя, то никакъв отчет за сделка не следва да бъде изготвен. Това е приложимо без значение дали прехвърлянето се осъществява в рамките на същия инвестиционен посредник или между два различни инвестиционни посредника или инвестиционен посредник и дружество, доколкото собствениците са едни и същи.

Ако инвестиционен посредник извършва прехвърляне между сметки, което води до сделка, счита се, че то е сключило сделка съгласно член 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Ако, все пак, единственият ангажимент на инвестиционния посредник е в качеството на осигуряване на административна помощ и изпълняване на прехвърлянето, то дружеството се счита, че не изпълнява сделката.

Прехвърлянията от сметка, държана от клиент към съвместна сметка, при която клиентът е един от съвместните титуляри, подлежи на отчитане. Също така, подлежи на отчитане, когато съвместна сметка се променя в сметка само с един собственик.

Този принцип се прилага също за прехвърляния от съвместни портфейли до индивидуални портфейли, разпределения от доверителни фондове към бенефициери, трансфери от попечителски сметки на родители за непълнолетни, когато непълнолетните станат пълнолетни, прехвърляния (или продажби обратно) на име на дружество, притежавано от физическо лице от споменатото физическо лице, прехвърляния към благотворителни дружества и в резултат на търгове или от инвестиционен посредник, който събира купувач и продавач.

Трансфери във връзка с движения, свързани с управление на завещание за починал клиент или наследства, търгове или подаръци подлежат на отчитане, тъй като тези сделки представляват придобивания и продажби, където се извършва промяна на собствеността, въпреки че липсва цена, включително промяна на собствеността на сметка за ценни книжа от един бенефициер на друг.

Полето цена следва да отразява платената цена, въпреки че може да се различава от пазарната цена. Когато съществува прехвърляне на финансови инструменти и не е платена цена (напр. подаръци или трансфери между фондове/портфейли), полето цена следва да се попълни с 'NOAP'.

#### Пример 49

Клиент А желае да прехвърли инструменти по сметката на клиент Б без каквото и да е плащане да бъде получено. Не се заплащат такси. Двете сметки се поддържат при същия инвестиционен посредник (дружество X), който извършва прехвърлянето.

Как трябва да докладва това прехвърляне инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционно дружество X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент Б	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на клиент А	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
33	Цена	'NOAP'	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>  <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> <i>- Обърнете внимание, че NOAP кодът следва да се използва, когато цената не е приложена.</i>

Датата и часът, които се отчитат, са датата и часа, когато инвестиционен посредник X е извършил прехвърлянето.

## 5.20.2 Прехвърляне между клиенти на два отделни инвестиционни посредника

### Пример 50

Клиент А желае да прехвърли 100 финансови инструмента от своята сметка при инвестиционен посредник X по сметката на клиент Б, поддържана при друг инвестиционен посредник, дружество Y. Инструкцията от клиент А е дадена на инвестиционен посредник X и е изпълнена на 05.10.2018 г. в 09:53:17 ч. Нито инвестиционен посредник X, нито инвестиционен посредник Y знаят самоличността на клиента на другия.



Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на клиент Б
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на клиент А	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	05.10.2018 г, 09:53:17 ч.	05.10.2018 г, 09:53:17 ч.
30	Количество	'100'	'100'
33	Цена	'NOAP'	'NOAP'
34	Валута на цената		

XML представителство:

Доклад на инвестиционен посредник X	Доклад на инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnc&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN&lt;LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/AcctOwnc&gt;         &lt;/Buyr&gt;       &lt;Sellr&gt;         &lt;AcctOwnc&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAA&lt;LEI&gt;               &lt;/Id&gt;             &lt;/AcctOwnc&gt;           &lt;/Sellr&gt;         ...       &lt;Tx&gt;         &lt;TradDt&gt;2018-10-05T09:53:17Z&lt;/TradDt&gt;         ...       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;NoPric&gt;           &lt;Pdg&gt;NOAP&lt;/Pdg&gt;         &lt;/NoPric&gt;       &lt;/Pric&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMN&lt;ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnc&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBB&lt;LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/AcctOwnc&gt;         &lt;/Buyr&gt;       &lt;Sellr&gt;         &lt;AcctOwnc&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;LEI&gt;               &lt;/Id&gt;             &lt;/AcctOwnc&gt;           &lt;/Sellr&gt;         ...       &lt;Tx&gt;         &lt;TradDt&gt;2018-10-05T09:53:17Z&lt;/TradDt&gt;         ...       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;NoPric&gt;           &lt;Pdg&gt;NOAP&lt;/Pdg&gt;         &lt;/NoPric&gt;       &lt;/Pric&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; </pre>

<pre> &lt;/NoPric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>	<pre> ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>
---	---

Инвестиционен посредник X и инвестиционен посредник Y следва да отчетат часа, когато са извършили трансфера и тези часове могат да се различават. Поле 28, дата и време на търгуване, отразява датата и времето на сделката, а не часът на предаване на поръчката.

### 5.20.3 Дружества, които извършват действия извънборсово за съответствие на две клиентски поръчки

#### Пример 51

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка извънборсово за клиент А - купувач и клиент Б - продавач. Нито един от клиентите няма задължения за отчитане на сделки. Сделката подлежи на публикуване след нейното осъществяване с извънборсов показател след сделката, определен на 'ACTX' (индикатор за сделките от вида „agency cross“).

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционно дружество X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на клиент Б	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
36	Място на провеждане	'XOFF'	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id>
63	Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката	'ACTX'	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>  <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>

			<pre> &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;AddtlAttrbts&gt; &lt;OTCPstTradInd&gt;ACTX&lt;/OTCPstTradInd&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

### Пример 52

Инвестиционен посредник X изпълнява сделка извънборсово за клиент А - купувач и клиент Б - продавач. Клиент Б е инвестиционен посредник, който попада в обхвата на задълженията за отчитане на сделки. Клиент Б няма основен клиент.

Как трябва да докладват инвестиционни дружества X и Б?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности дружество Б
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на дружество Б
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционно дружество Б	{LEI} на инвестиционно дружество Б
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'
63	Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката	'ACTX'	

XML представителство:

Доклад на инвестиционен посредник X	Доклад на инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt; </pre>

<pre> &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   ... &lt;/Tx&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;   &lt;OTCPstTradInd&gt;ACTX&lt;/OTCPstTradInd&gt;   ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

Ако клиент А е инвестиционен посредник, попадащ в обхвата на задължения за отчитане на сделки, той ще трябва да идентифицира в своя отчет за сделка инвестиционен посредник X като продавача.

## 5.21 Инвестиционният посредник представя без да противопоставя поръчки

### 5.21.1 Инвестиционен посредник, който съчетава две поръчки от клиенти без да ги противопоставя

#### Пример 53

Инвестиционен посредник X желае да продаде даден инструмент по своята сметка.

Инвестиционен посредник Y желае да купи този същия инструмент по своята сметка.

Инвестиционен посредник Z събира инвестиционни посредници X и Y, но не е страна по сделката.

Инвестиционни посредници X и Y договарят помежду си параметрите на сделката.

Инвестиционен посредник Z няма каквото и да е задължение за отчитане, вместо това дружества X и Y следва да се отчитат.

Инвестиционен посредник X знае в момента на изпълнение, че Y е негов контрагент.

Инвестиционен посредник Y знае в момента на изпълнение, че X е негов контрагент.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Стойности на доклад Инвестиционен посредник Y
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'

XML представителство:

Доклад на инвестиционен посредник X	Доклад на инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;     ...     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/E xctgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;     ...     &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

### 5.21.2 Инвестиционен посредник представя свой клиент на друг инвестиционен посредник без да посредничи

#### Пример 54

Клиент А желае да купи даден инструмент. Неговият брокер, дружество X, не търгува с подобни инструменти и представя клиент А на инвестиционен посредник Y.

Инвестиционен посредник Y купува финансови инструменти за клиент А на място на търговия М. Инвестиционен посредник Y знае в момента на изпълнение, че клиент А е негов клиент и клиент А знае, че има отношения с инвестиционен посредник Y за тази сделка. Инвестиционен посредник X няма роля в изпълнението и само получава комисионна от инвестиционен посредник Y за представянето.

Тъй като инвестиционен посредник X не е изпълнил сделката, дружеството не подава отчет за сделката.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник Y?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </New> </Tx>

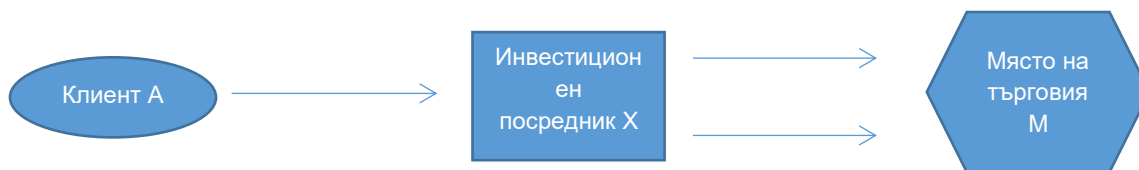
Ако клиент А е инвестиционен посредник, той следва също да се отчита като идентифицира инвестиционен посредник Y като продавача.

Това се различава от предаването, което отговаря на условията на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, тъй като в този сценарий основният клиент установява отношение с дружеството, на което е представен. Инвестиционен посредник X ефективно предава отношението на инвестиционен посредник Y. Това е в противовес на ситуацията, при която отношението остава при предаващото дружество и единствено информацията на клиента бива предадена.

## 5.22 Една поръчка за един клиент изпълнена в множество сделки

### 5.22.1 Изпълнение на поръчката на клиента чрез изпълнение на място и след това предоставяне на клиента от собствения регистър на инвестиционния посредник

#### Пример 55



Client A	Клиент А
Investment Firm X	Инвестиционен посредник X
Trading Venue M	Място на търговия М

Клиент А подава поръчка за покупката на 500 акции до инвестиционен посредник X.

Инвестиционен посредник X изпълнява поръчката на място на търговия М в две изпълнения, едно на 24 юни 2018 г. в 14:25:13.159124 ч. за 300 акции при 99 SEK и едно на 24 юни 2018 г. в 15:55:13.746133 ч. за 200 акции при 100 SEK. Клиентът желае да получи средна цена.

- а) инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка

Сделките първо се регистрират в собствените регистри на инвестиционен посредник X и след това по-късно се регистрират на клиента в 16:24:12 ч. в същия ден при претеглена средна цена за обем в размер на 99.40 SEK.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент А
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на инвестиционен посредник X

28	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 14:25:13.159 ч.'	'24.06.2018 г., 15:55:13.746 ч.'	'24.06.2018 г., 16:24:12 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'300'	'200'	'500'
33	Цена	'99'	'100'	'99.40'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456     7890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;11111111111111111111           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-06-       24T14:25:13.159Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;/Tx&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt           Ccy="SEK"&gt;99&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456     7890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;11111111111111111111           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-06-       24T15:55:13.746Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;/Tx&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt           Ccy="SEK"&gt;100&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234     567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAA           AAAAA&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;1234567890123456789           0&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-06-       24T16:24:12Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;     &lt;/Tx&gt;     &lt;Qty&gt;       &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt           Ccy="SEK"&gt;99.4&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt; </pre>



<pre> ... &lt;/Tx&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	---

б) инвестиционен посредник търгува на база съответстваща главница

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент А
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М
20	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 14:25:13.159 ч.'	'24.06.2018 г., 15:55:13.746 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'MTCH'	'MTCH'
30	Количество	'300'	'200'
33	Цена	'99'	'100'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия М

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;111111111111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;111111111111111111&lt;/LEI&gt; </pre>

<pre> ... &lt;Tx&gt; ... &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T14:25:13.159&lt;/TradDt&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ... &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:55:13.746&lt;/TradDt&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;100&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---

Въпреки че клиентът желае средна цена, отчетите за сделки трябва да отразяват, че всяко едно изпълнение на пазара незабавно се предава на клиента, защото инвестиционният посредник търгува за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки.

в) инвестиционен посредник търгува на база „всяко друго качество“

Отчетите за сделки на инвестиционен посредник X, който търгува на база „всяко друго качество“ са точно същите като отчетите за търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки по-горе, с изключение че свързаното с търговия качество се отчита като ‘АОТС’, а не като ‘МТСН’.

### 5.22.2 Изпълнение на поръчката на клиента чрез получаване на част от място и предоставяне на инструментите на клиента от собствения регистър на инвестиционния посредник

#### Пример 56

Клиент А подава поръчка за покупката на 600 акции до инвестиционен посредник X. Клиентът желае да получи средна цена.

Инвестиционен посредник X изпълнява поръчката на клиент А, както следва:

- 1) Той извършва две изпълнения на място на търговия М, едно на 24 юни 2018 г. в 14:25:13.159124 ч. за 300 акции при 99 SEK и едно на 24 юни 2018 г. в 15:55:13.746133 ч. за 200 акции при 100 SEK.
- 2) Инвестиционен посредник X осигурява 600 акции на клиента в 16:24:12 ч. в същия ден при средна цена 99.416 SEK.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2	Доклад със стойности #3
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент А
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на инвестиционен посредник X
20	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 14:25:13.159 ч.'	'24.06.2018 г., 15:55:13.746 ч.'	'24.06.2018 г., 16:24:12 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'300'	'200'	'600'
33	Цена	'99'	'100'	'99.41666666666666'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'

XML представителство:

Доклад #1 (от гледна точка на пазара)	Доклад #2 (от гледна точка на пазара)	Доклад #3 (от гледна точка на клиента)
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>

<pre> &lt;AcctOwNr&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;11111111111111111111 1&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwNr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T14:25:13.159Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;AcctOwNr&gt;   &lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;11111111111111111111 111&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwNr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:55:13.746Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;100&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;AcctOwNr&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwNr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T16:24:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;600&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.416666666666 66&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	--	--

## 5.23 Групиране на нареждания

Съвкупната клиентска сметка ('INTC') следва единствено да се използва при обстоятелствата, посочени в настоящите насоки. Тя не следва да се използва за отчитане на поръчка за един клиент, изпълнена при едно изпълнение или за поръчка за един клиент, изпълнена в множество изпълнения. Когато съществува превод по съвкупната клиентска сметка ('INTC'), трябва да има съответен превод от съвкупната клиентска сметка в рамките на същия работен ден на изпълняващия субект в отчета за сделка, така че съвкупната клиентска сметка да е равнена. Очевидното преминаване през 'INTC' е конвенция, използвана за отчитане за осигуряване на връзка между пазарната страна и клиентската страна на сделки и не посочва, че подобна клиентска сметка съществува в действителност или че собствеността на инструмента действително преминава през регистрите на инвестиционния посредник.

Член 11, параграф 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията гласи, че изискванията за къса продажба съгласно Регламент (ЕС) № 236/2012 се прилагат, когато инвестиционен посредник обобщава поръчки от няколко клиента. Това означава, че член 11, параграф 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията единствено се прилага а отчетите, които показват сделки с клиенти физически лица, а не обобщен отчет за пазарна сделка. В случая с отчет за пазарна сделка, който обобщава сделки за продажба, клиенти, показателят за къса

продажба следва да бъде празен. Това е, защото обобщеният отчет за пазарна сделка е свързан с всички клиенти, чиито поръчки са обобщени и не може да посочи показател за къса продажба на необходимото ниво на детайлност. Показателят за къса продажба за клиенти физически лица вместо това се отчита в отчети за сделки от страна на клиент физическо лице (вж. раздели 5.24 и 5.27.2).

### 5.23.1 Едно изпълнение на пазара за няколко клиента

#### Пример 57

Двама клиента на инвестиционен посредник X, клиент А и клиент Б, подават поръчки за продажба за 100 и 200 дяла съответно.

Клиент А извършва къса продажба. Клиент Б не съобщава на инвестиционен посредник X дали осъществява къса продажба. Инвестиционен посредник X е равен. Инвестиционен посредник X обобщава поръчките и ги изпълнява на 16 септември 2018 г. в 09:20:15.374215 ч. на място на търговия М в една сделка от 300 при 25,54 EUR. Тогава те се разпределят на клиентите в 09:35:104 ч.

#### 5.23.1.1 Инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б
28	Дата и време на търгуване	'16.09.2018 г., 09:20:15.374 ч.'	'16.09.2018 г., 09:35:10 ч.'	'16.09.2018 г., 09:35:10 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'300'	'100'	'200'
33	Цена	'25.54'	'25.54'	'25.54'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'	'XOFF'
62	Показател за къса продажба	'SESH'	'SESH'	'UNDI'

XML представителство:

Доклад # 1

Доклад # 2

Доклад # 3

<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;ExctgPty&gt;123456789012345 67890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111 1&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:20:15.374Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCp cty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSell gInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt; /LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;   ...   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:35:10Z&lt;/TradDt&gt;   ...  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpct y&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;    ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   ...   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellg Ind&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234 567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:35:10Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgC pcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   ...   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;UNDI&lt;/ShrtSell gInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	---



<pre> &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ...   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:20:15.374Z&lt;/TradDt&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgC pcty&gt; ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;New&gt; ... &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ...   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:20:15.374Z&lt;/TradDt&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpc ty&gt; ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;AddtlAttrbts&gt; ... &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellg Ind&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 16T09:20:15.374Z&lt;/TradDt&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgC pcty&gt; ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;AddtlAttrbts&gt; ... &lt;ShrtSellgInd&gt;SELL&lt;/ShrtSell gInd&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	---

Цената, датата и времето на търгуване следва да бъдат идентични в трите отчета за сделки. Цената, датата и времето на търгуване следва да бъдат цената, датата и времето на изпълнение на пазара. Доклади #2 и #3 показват разпределенията за клиента на сделката, изпълнена на мястото на търговия съгласно „всяко друго качество“. Следователно, нивото на детайлност за дата и време на пазарното изпълнение следва да бъде спазвано в отчетите за разпределения за клиентите.

### 5.23.2 Няколко изпълнения на пазара за няколко клиента

#### Пример 58



Трима клиента на инвестиционен посредник X - клиент А, клиент Б и клиент В - подават поръчки за покупка на 100, 200 и 300 инструмента съответно.

Инвестиционен посредник X се е съгласил да предостави на клиентите си средна цена и обобщава поръчките по-горе, като ги изпълнява в две сделки на място на търговия М, една за 400 при 99 SEK (дата и време: 15 септември 2018 г. в 11:32:27.431 ч.) и една за 200 при 100 SEK (дата и час: 15 септември 2018 г., в 11:42:54.192 ч.). Той разпределя сделки на клиентите в 12:15:23 ч. същия ден.

#### 5.23.2.1 Инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка

Как инвестиционен посредник X следва да докладва сделки от страна на пазара?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М
28	Дата и време на търгуване	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'	'15.09.2018 г., 11:42:54.192 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'400'	'200'
33	Цена	'99'	'100'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	Сегмент {MIC} на място на търговия М

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt; </pre>

<pre> ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;400&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ..   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09-15T11:42:54. 192Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;100&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

Как инвестиционен посредник X следва да докладва сделките на клиентите?

N	Поле	Доклад със стойности #3	Доклад със стойности #4	Доклад със стойности #5
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б	{LEI} на клиент В
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'15.09.2018 г., 12:15:23 ч.'	'15.09.2018 г., 12:15:23 54 ч.'	'15.09.2018 г., 12:15:23 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'100'	'200'	'300'
33	Цена	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 3	Доклад # 4	Доклад # 5
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567 890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AA&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/ LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T12:15:23 Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpct y&gt;       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.3333333333333 &lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;       ...     &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T12:15:23 Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpc ty&gt;       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.3333333333333 3&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;       ...     &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123 4567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;CCCCCCCCCCCCC CCCCCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;123456789012345678 90&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T12:15:23 Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/Tradg Cpcty&gt;       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.3333333333 333&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;       ...     &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Тъй като инвестиционен посредник X тъгува за собствена сметка, датата и времето за отчетите от страна на клиента отразяват часовете, когато финансовите инструменти са разпределени на клиентите.

#### 5.23.2.2 Инвестиционен посредник X тъгува на база „всяко друго качество“

Как инвестиционен посредник X следва да докладва сделки от страна на пазара?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	'INTC'
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M
28	Дата и време на търгуване	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'	'15.09.2018 г., 11:42:54.192 ч.'
29	Качеството, в което лицето тъгува	'АОТС'	'АОТС'
30	Количество	'400'	'200'
33	Цена	'99'	'100'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	Сегмент {MIC} на място на търговия M

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; &gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; </pre>



<pre> ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.3333333333333 '&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.3333333333333 '&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;CCCCCCCCCCCCCCC CCCCC&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/Tradg Cpcty&gt;     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99.33333333333 33'&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--

Нивото на детайлност по отношение на дата и време на изпълнението на пазара следва да бъде спазвано в отчетите за разпределение на клиентите, тъй като сделките са изпълнени на мястото на търговия на база „всяко друго качество“.

Когато инвестиционен посредник X търгува на база „всяко друго качество“, датата и времето за търговия за разпределенията до клиентите са датата и времето на първото изпълнение на пазара, а не последното.

### 5.23.2.3 Инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки

Инвестиционно дружество X не може да използва 'MТСН' когато извършва сделки в други часове.

#### 5.23.2.4 Инвестиционен посредник X търгува на база „смесено свързано с търговия качество“

##### Пример 59

Съгласно горепосочения пример, но инвестиционен посредник X изпълнява част от поръчката от своите собствени регистри (200 дяла при 100 SEK). Тъй като съвкупната клиентска сметка ('INTC') трябва да бъде равнена в края на деня и дружество X осигурява 200 единици за частично изпълнение на няколко клиентски поръчки, отчет, който посочва, че превод от собствената сметка на дружество X до сметка 'INTC' трябва да бъде извършен, за балансиране на сумата от страна на пазара и от страна на разпределението до клиента (отчет #2).

Как инвестиционен посредник X следва да докладва сделки от страна на пазара?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	'INTC'
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'	'15.09.2018 г., 11:35:30 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
30	Количество	'400'	'200'
33	Цена	'99'	'100'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt; </pre>

<pre> &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;400&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;99&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09-15T11:35:30Z &lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="SEK"&gt;100&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

Как инвестиционен посредник X следва да докладва разпределенията на клиентите?

N	Поле	Доклад със стойности #3	Доклад със стойности #4	Доклад със стойности #5
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б	{LEI} на клиент В
16	Код за идентифициране на продавач	'INTC'	'INTC'	'INTC'
28	Дата и време на търгуване	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'	'15.09.2018 г., 11:32:27.431 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'100'	'200'	'300'
33	Цена	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 3	Доклад # 4	Доклад # 5
<Tx>	<Tx>	<Tx>



<pre> &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAA AAAAAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt&gt; <b>Ccy="SEK"&gt;93.33333333333333</b>       &lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt&gt; <b>Ccy="SEK"&gt;93.33333333333333</b>       &lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;New&gt; ... &lt;ExctgPty&gt;12345678901234 567890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;CCCCCCCCCCCCCC CCCCC&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-09- 15T11:32:27.431Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/Tradg Cpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt&gt; <b>Ccy="SEK"&gt;93.33333333333333</b>       &lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	---

Датата и времето за търговия за разпределенията до клиентите са датата и времето на първото изпълнение на пазара. Нивото на детайлност по отношение на дата и време на изпълнението на пазара следва да бъде спазвано в отчетите за разпределение на клиентите, тъй като сделките са изпълнени на мястото на търговия на база „всяко друго качество“.

5.23.2.5 Няколко сделки, изпълнени на различни места, където инвестиционен посредник X търгува на база „всяко друго качество“

Пример 60

На 24 юли 2018 г. инвестиционен посредник X получава поръчки за покупка на 400 за клиент А и 600 за клиент Б. Поръчката е изпълнена на три транша както следва:

200 дяла на 24.07.2018 г. в 15:33:33 ч. при 100,21 EUR (контрагент инвестиционен посредник Y)

300 дяла на 24.07.2018 г. в 17:55:55 ч. при 100,52 EUR (контрагент инвестиционен посредник Z)

500 дяла на 25.07.2018 г. в 13:11:11 ч. при 100,96 EUR (контрагент дружество X с LEI: VVVVVVVVVVVVVVVVVVVVV)

Как инвестиционен посредник X следва да отчита сделки от страна на пазара и допълнително разпределение?

*5.23.2.5.1 Клиентите получават средна цена*

Въпреки че поръчката не е изпълнена изцяло, следва да има разпределение до клиентите в края на всеки ден, тъй като сметка 'INTC' не може да покаже промените в позиция за повече от един ден.

Съгласно вътрешните процедури на инвестиционен посредник X, клиентите трябва да бъдат третираны еднакво, така че не е налице предпочитание към който и да е от тях.

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3	Стойности Доклад # 4
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционно дружество X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционно дружество X	{LEI} на инвестиционно дружество X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционно дружество Y	{LEI} на инвестиционен посредник Z	'INTC'	'INTC'
28	Дата и време на търгуване	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'	'24.07.2018 г., 17:55:55 ч.'	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'200'	'300'	'250'	'250'
33	Цена	'100.21'	'100.52'	'100.396'	'100.396'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3	Доклад # 4
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgP ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T15:33:33Z&lt;/TradDt &gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.21&lt;/ Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgP ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;8888888888888 8888888&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T17:55:55Z&lt;/TradDt &gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.52&lt;/ Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgP ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T15:33:33Z&lt;/TradDt &gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.396&lt;/ Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678 901234567890&lt;/Exct gPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T15:33:33Z&lt;/TradD t&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt; /TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.396 &lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Tra dVn&gt;   &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Както за сделката, извършена на 25.07.2018 г.:

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2	Доклад със стойности #3
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на дружество X	'INTC'	'INTC'
28	Дата и време на търгуване	'25.07.2018 г., 13:11:11 ч.'	'25.07.2018 г., 13:11:11 ч.'	'25.07.2018 г., 13:11:11 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'500'	'150'	'350'
33	Цена	'100.96'	'100.96'	'100.96'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;VVVVVVVVVVVVVVVVVV VVV&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678901234 567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; </pre>

<pre> &lt;TradDt&gt;2018-07-25T13:11:11Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.96&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradDt&gt;2018-07-25T13:11:11Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;150&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.96&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradDt&gt;2018-07-25T13:11:11Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;   &lt;Unit&gt;350&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.96&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	---

#### 5.23.2.5.2 Поръчки изпълнени на принципа „първ пристигнал, първ обслужен“

Вътрешните процедури на дружество X дават приоритет за време при разпределението до неговите клиенти при изпълнението на обобщени сделки. Тъй като инвестиционен посредник X е получил поръчката от клиент А първо, клиент А получава общото количество на инструментите (400 при средна цена от 100 365 EUR) със своята изцяло изпълнена поръчка. Останалата сума на изпълнението е за клиент Б.

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3	Стойности Доклад # 4
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Z	'INTC'	'INTC'
28	Дата и време на търгуване	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'	'24.07.2018 г., 17:55:55 ч.'	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'	'24.07.2018 г., 15:33:33 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'200'	'300'	'400'	'100'
33	Цена	'100.21'	'100.52'	'100.365'	'100.52'

36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
----	---------------------	--------	--------	--------	--------

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3	Доклад # 4
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890 1234567890&lt;/ExctgPty &gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T15:33:33Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/T radgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.21&lt;/A mt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradV n&gt;     &lt;/Tx&gt;     ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890 1234567890&lt;/ExctgPty &gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;88888888888888 888888&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T17:55:55Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/T radgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.52&lt;/A mt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradV n&gt;     &lt;/Tx&gt;     ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgP ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;  &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018- 07- 24T15:33:33Z&lt;/TradDt &gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/T radgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;400&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.365&lt; /Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456 78901234567890&lt;/E xctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB BBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;  &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-07- 24T15:33:33Z&lt;/Tra dDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOT C&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.5 2&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ... </pre>

<code>&lt;/New&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code>	<code>&lt;/New&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code>	... <code>&lt;/New&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code>	<code>&lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code> ... <code>&lt;/New&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code>
---	---	--	--

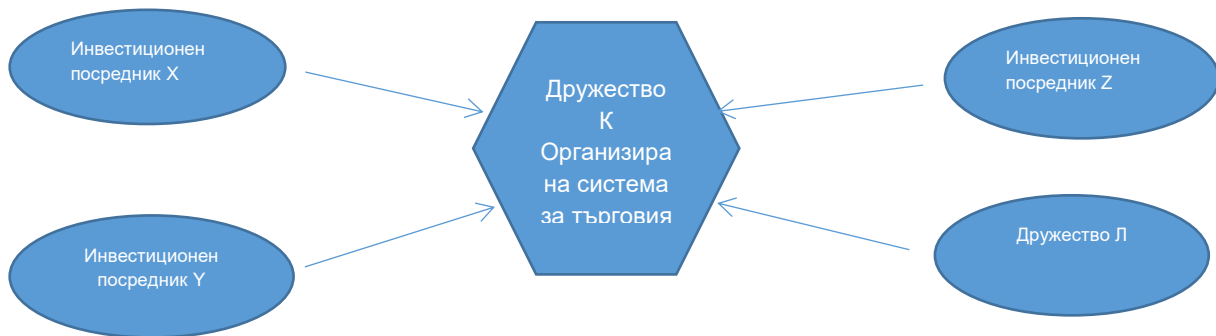
Относно сделката, извършена на 25.07.2018 г., тя ще бъде насочена към клиент Б и 'INTC' не трябва да се използва.

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<code>&lt;Tx&gt;</code> <code>&lt;New&gt;</code> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент Б	<code>&lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;</code> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на дружество X	<code>&lt;Buyr&gt;</code> <code>&lt;AcctOwnr&gt;</code> <code>&lt;Id&gt;</code> <code>&lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;</code> <code>&lt;/Id&gt;</code> <code>&lt;/AcctOwnr&gt;</code>
28	Дата и време на търгуване	'25.07.2018 г., 13:11:11 ч.'	<code>&lt;/Buyr&gt;</code> <code>&lt;Sellr&gt;</code> <code>&lt;AcctOwnr&gt;</code> <code>&lt;Id&gt;</code>
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	<code>&lt;Sellr&gt;</code> <code>&lt;AcctOwnr&gt;</code> <code>&lt;Id&gt;</code>
30	Количество	'500'	<code>&lt;LEI&gt;VVVVVVVVVVVVVVVVVVVV&lt;/LEI&gt;</code> <code>&lt;/Id&gt;</code> <code>&lt;/AcctOwnr&gt;</code> <code>&lt;/Sellr&gt;</code>
33	Цена	'100.96'	<code>&lt;/AcctOwnr&gt;</code> <code>&lt;/Sellr&gt;</code> ...
36	Място на провеждане	'XOFF'	<code>&lt;Tx&gt;</code> <code>&lt;TradDt&gt;2018-07-25T13:11:11Z&lt;/TradDt&gt;</code> <code>&lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;</code> <code>&lt;Qty&gt;</code> <code>&lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;</code> <code>&lt;/Qty&gt;</code> <code>&lt;Pric&gt;</code> <code>&lt;Pric&gt;</code> <code>&lt;MntryVal&gt;</code> <code>&lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100.96&lt;/Amt&gt;</code> <code>&lt;/MntryVal&gt;</code> <code>&lt;/Pric&gt;</code> <code>&lt;/Pric&gt;</code> <code>&lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code> ... <code>&lt;/New&gt;</code> <code>&lt;/Tx&gt;</code>

## 5.24 организирана система за търговия, която извършва действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“

Организирана система за търговия, когато извършва действия по подобен начин на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ извършва действия като инвестиционен посредник и се отчита по подобен начин като инвестиционен посредник. Всички страни, които работят с организирана система за търговия и организираната система за търговия отчитат полето място като сегмент MIC на организираната система за търговия. Организирана система за търговия, която извършва действия на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ съчетава поръчка за покупка от един или повече клиенти с поръчки за продажба от един или повече клиенти.

### Пример 61



Инвестиционен посредник К, организирана система за търговия, с LEI: OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT и сегмент MIC на OTFX, извършва действия „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ и неговият алгоритъм с код: ‘1234ABC’ съответства на поръчка за покупка за държавни дългови инструменти от два инвестиционни посредника, дружество X и дружество Y, с две поръчки за продажба от два други инвестиционни посредника, дружества Щ и Л. Инвестиционно дружество Л има LEI: 77777777777777777777.

Инвестиционни посредници X и Y купуват 300 и 100 държавни дългови инструменти съответно, а инвестиционни посредници Z и Л продават 150 и 250 държавни дългови инструменти съответно.

Инвестиционни посредници X, Y, Z и L извършват действия в свързано с търговия качество „за собствена сметка“. Дружество 1 е взело инвестиционното решение и е извършило изпълнението за инвестиционен посредник X. Търговец 4 е взел инвестиционното решение и е извършил изпълнението за инвестиционен посредник Y. Търговец 5 е взел инвестиционното решение и е извършил изпълнението за инвестиционен посредник Z. Търговец 7 е взел инвестиционното решение и е извършил изпълнението за инвестиционно дружество Л. Търговец 9 е Патрик Даун, ирландски гражданин, с дата на раждане: 14 юли 1960 г.

Инвестиционно дружество К съчетава поръчките на 9 юни 2018 г. в 16:41:07.1234 ч. и при цена от 42,7 EUR.

Инвестиционен посредник Z осъществява къса продажба без изключение, инвестиционно дружество L не извършва къса продажба.





<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234 567890&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;  &lt;Algo&gt;1234ABC&lt;/Algo &gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;  &lt;Algo&gt;1234ABC&lt;/Algo &gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;88888888888888 888888&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/ TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;150&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;  &lt;Algo&gt;1234ABC&lt;/Algo &gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;7777777777777 77777777&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;  ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tr adDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;MTC H&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/A mt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Tr adVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;  &lt;Algo&gt;1234ABC&lt;/A lgo&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SEL L&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	---	---

Тъй като има повече от един клиент, участващ във всяка страна в този пример, обобщената клиентска сметка 'INTC' трябва да се използва за свързване на страната на купувача и страната на продавача. Вж. раздел 5.23

Как клиентите на организирана система за търговия следва да отчитат осъществените сделки?

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3	Стойности Доклад # 4
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционно дружество L
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник K	{LEI} на инвестиционен посредник K
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен Дружество K	{LEI} на инвестиционен Дружество K	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционно дружество L
28	Дата и време на търгуване	'09.06.2018 г., 16:41:07.123 ч.'	'09.06.2018 г., 16:41:07.123 ч.'	'09.06.2018 г., 16:41:07.123 ч.'	'09.06.2018 г., 16:41:07.123 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'300'	'100'	'150'	'250'
33	Цена	'42.7'	'42.7'	'42.7'	'42.7'
36	Място на провеждане	'Сегмент {MIC} на инвестиционно дружество K/OTF'	'Сегмент {MIC} на инвестиционно дружество K/OTF'	'Сегмент {MIC} на инвестиционно дружество K/OTF'	'Сегмент {MIC} на инвестиционно дружество K/OTF'
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 1	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 5	{NATIONAL_ID} на търговец 7
62	Показател за къса продажба			'SESH'	'SELL'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3	Доклад # 4
<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgPty&gt; ...</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGH IJKLMNOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ...</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;888888888 88888888888&lt;/ExctgPty&gt; ...</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;7777777 7777777777777&lt;/ExctgPty&gt; ...</pre>

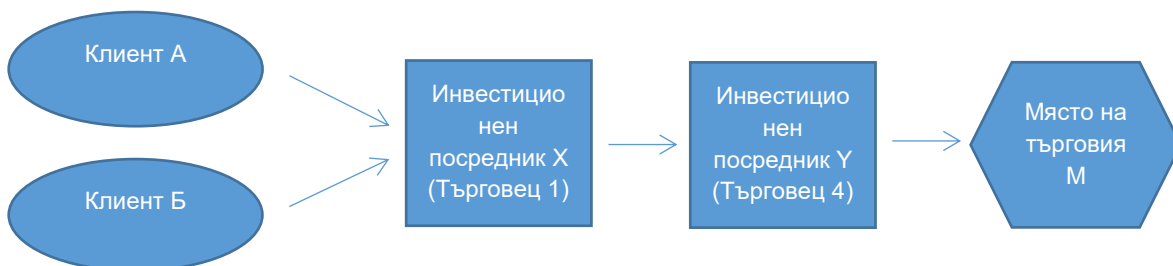
<pre> &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234 567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/T radgCpcty&gt; &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt;  &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA111222333444 5555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; </pre>	<pre> &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/T radgCpcty&gt; &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19631202MARI ECLAIR&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/ Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; </pre>	<pre> &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;88888888888888 888888&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 06- 09T16:41:07.123Z&lt;/Tra dDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/T radgCpcty&gt; &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;150&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/Amt &gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Trad Vn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FI1234567890A&lt;/I d&gt; &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; </pre>	<pre> &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;OTFOTFOTFOT OTFOTFOTFOT&lt;/L EI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;777777777777 777777777&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06- 09T16:41:07.123Z&lt;/L TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL &lt;/TradgCpcty&gt; &lt;Qty&gt;  &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;42.7&lt;/ Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;OTFX&lt;/Tr adVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19720504JE AN#BERNA&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; </pre>
---	---	--	---

<pre> &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt; ... &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ ShrtSellgInd&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/P rtry&gt; ... &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt; ... &lt;ShrtSellgInd&gt;SEL L&lt;/ShrtSellgInd&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

## 5.25 Основани на стойност сделки с балансираща единица

Това може да се случи, когато инвестиционните посредници предлагат ежедневна обобщена търговия като икономична възможност за индивидуални клиенти.

### Пример 62



Двама клиенти на испански инвестиционен посредник X решават да купят същия финансов инструмент, клиент А за сумата от 400 EUR и клиент Б за сумата от 200 EUR. Търговец 1 изпраща обобщената поръчка на стойност 600 EUR до инвестиционен посредник Y. Търговец 4 изпълнява поръчката при едно изпълнение на място на търговия М на 24 юни 2018 г. в 14:25:30.1264 ч. за пет единици от инструмента при цена 120 EUR и потвърждава завършеното изпълнение на инвестиционен посредник X. Инвестиционен посредник X разпределя три от тези единици до клиент А на стойност 360 EUR, и една единица до клиент Б на стойност 120 EUR. Балансиращата единица на един инструмент се разпределя от системите на инвестиционен посредник X (ALGOABC) до неговата собствена сметка с намерение да бъде продаден, когато е възможно. Това държане е за административни цели, а не е предвидено като собствена инвестиция.

Инвестиционен посредник X не изпълнява условията за предаване на поръчка съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Как трябва да отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3	Стойности Доклад # 4
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б
12	Купувач, който взема решението				
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	'INTC'	'INTC'	'INTC'
21	Код на продавач, който взема решението				
28	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.2018 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.2018 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.2018 г., 14:25:30 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'5'	'1'	'3'	'1'
33	Цена	'120'	'120'	'120'	'120'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		{Код на алгоритъма}		
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение				
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 1	{Код на алгоритъма}	{NATIONAL_ID} на търговец 1	{NATIONAL_ID} на търговец 1
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето,	'ES'		'ES'	'ES'

отговарящо за изпълнението				
----------------------------	--	--	--	--

XML представителство:

Доклад # 1 От страна на пазара	Доклад # 2 От страната на клиента	Доклад # 3 От страната на клиента	Доклад # 4 От страната на клиента
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;             &lt;/Id&gt;             &lt;/AcctOwnr&gt;             &lt;/Buyr&gt;             &lt;Sellr&gt;               &lt;AcctOwnr&gt;                 &lt;Id&gt;                   &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;                 &lt;/Sellr&gt;               ...             &lt;Tx&gt;               &lt;TradDt&gt;2018-06-24T14:25:30Z&lt;/TradDt&gt;             &lt;TradCpcty&gt;AOTC&lt;/TradCpcty&gt;               &lt;Qty&gt;                 &lt;Unit&gt;5&lt;/Unit&gt;               &lt;/Qty&gt;               &lt;Pric&gt;                 &lt;MntryVal&gt;                   &lt;Amt&gt;                     &lt;Ccy&gt;"EUR"&gt;120&lt;/Amt&gt;                   &lt;/MntryVal&gt;                 &lt;/Pric&gt;               &lt;/Pric&gt;             &lt;/Tx&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;       &lt;/Buyr&gt;     &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;         &lt;/Buyr&gt;         &lt;Sellr&gt;           &lt;AcctOwnr&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;                 &lt;/Sellr&gt;               ...             &lt;Tx&gt;               &lt;TradDt&gt;2018-06-24T14:25:30Z&lt;/TradDt&gt;             &lt;TradCpcty&gt;DEAL&lt;/TradCpcty&gt;               &lt;Qty&gt;                 &lt;Unit&gt;1&lt;/Unit&gt;               &lt;/Qty&gt;               &lt;Pric&gt;                 &lt;MntryVal&gt;                   &lt;Amt&gt;                     &lt;Ccy&gt;"EUR"&gt;120&lt;/Amt&gt;                   &lt;/MntryVal&gt;                 &lt;/Pric&gt;               &lt;/Pric&gt;             &lt;/Tx&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;       &lt;/Buyr&gt;     &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;         &lt;/Buyr&gt;         &lt;Sellr&gt;           &lt;AcctOwnr&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;                 &lt;/Sellr&gt;               ...             &lt;Tx&gt;               &lt;TradDt&gt;2018-06-24T14:25:30Z&lt;/TradDt&gt;             &lt;TradCpcty&gt;AOTC&lt;/TradCpcty&gt;               &lt;Qty&gt;                 &lt;Unit&gt;3&lt;/Unit&gt;               &lt;/Qty&gt;               &lt;Pric&gt;                 &lt;MntryVal&gt;                   &lt;Amt&gt;                     &lt;Ccy&gt;"EUR"&gt;120&lt;/Amt&gt;                   &lt;/MntryVal&gt;                 &lt;/Pric&gt;               &lt;/Pric&gt;             &lt;/Tx&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;       &lt;/Buyr&gt;     &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;         &lt;/Buyr&gt;         &lt;Sellr&gt;           &lt;AcctOwnr&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;                 &lt;/Id&gt;                 &lt;/AcctOwnr&gt;                 &lt;/Sellr&gt;               ...             &lt;Tx&gt;               &lt;TradDt&gt;2018-06-24T14:25:30Z&lt;/TradDt&gt;             &lt;TradCpcty&gt;AOTC&lt;/TradCpcty&gt;               &lt;Qty&gt;                 &lt;Unit&gt;1&lt;/Unit&gt;               &lt;/Qty&gt;               &lt;Pric&gt;                 &lt;MntryVal&gt;                   &lt;Amt&gt;                     &lt;Ccy&gt;"EUR"&gt;120&lt;/Amt&gt;                   &lt;/MntryVal&gt;                 &lt;/Pric&gt;               &lt;/Pric&gt;             &lt;/Tx&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/AcctOwnr&gt;       &lt;/Buyr&gt;     &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>

<pre> &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Algo&gt;ALGOABC&lt;/Algo&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Algo&gt;ALGOABC&lt;/Algo&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;ES&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---	---	---

Полета 58 и 60 са празни в отчет 2, тъй като полета 57 и 59 са попълнени с алгоритъм. За отчети 1, 3 и 4, инвестиционното решение в рамките на дружеството (поле 57) е празно, тъй като инвестиционен посредник X извършва действия във „всяко друго качество“; поле 60, тъй като няма участващ клон, се попълва с кода на държавата на инвестиционен посредник X (ES).

Същата ситуация може да се случи, когато инвестиционен посредник извършва действия за клиент съгласно неограничен мандат.

За отчета относно балансиращата единица, тъй като решението е взето от дружеството, но не е взето от физическо лице, поле 57 следва да се попълни с код на алгоритъм от дружеството.

## 5.26 Вериги и предаване

Този раздел съдържа примери, свързани със:

вериги, където условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) не са изпълнени (подраздел **Error! Reference source not found.**).

вериги, при които условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) са спазени, но не всички други условия в член 4 са спазени (подраздел 5.26.2).

вериги, при които е налице предаване и условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от всички инвестиционни посредници (подраздел 5.26.3).

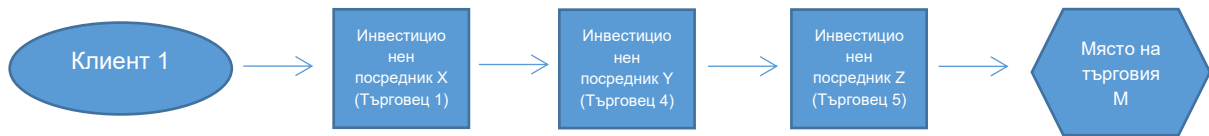
вериги, при които условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от някои инвестиционни посредници (подраздел 5.26.4).





За общо обяснение на веригите и предаването вижте съответните раздели **Error! Reference source not found.** в част I.

### Пример 63



Клиент 1, който е клиент на инвестиционен посредник X, решава да продаде някои акции и инструктира инвестиционен посредник X. Търговец 1 решава да приеме поръчката от клиент 1 и решава да изпрати поръчката до инвестиционен посредник Y. Търговец 4 решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник X и решава да изпрати поръчката до инвестиционен посредник Z. Търговец 5 при инвестиционен посредник Z решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник Y и алгоритъм ALGO12345 при инвестиционен посредник Z избира място на търговия М за изпращане на поръчката. Тогава поръчката е завършена в регистъра с поръчки на място на търговия М от инвестиционен посредник Z в 13:40:23.4672 ч. на 1 юли 2018 г. при цена 32,5 EUR. Място на търговия М определя идентификационен код на сделка: '1234'.

#### 5.26.1 Вериги, където условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) не са изпълнени

Следният пример показва как отчетите за сделки се попълват в контекста на веригите, където условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) не са изпълнени, като всяко инвестиционно дружество отчита своя непосредствен контрагент или клиент и също как полета 25-27 за предаването са попълнени за този сценарий. Това се случва, когато инвестиционен посредник търгува за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки или за собствена сметка. За общо обяснение на този тип верига, разгледайте подраздел 5.3.2 в част 1 от настоящите насоки.

### Пример 64

Инвестиционни посредници Y и Z търгуват за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, а инвестиционен посредник X търгува за собствена сметка.

Как отчитат инвестиционни посредници X, Y и Z?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
		инвестиционен посредник Z	инвестиционен посредник Y	инвестиционен посредник X	инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'			
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X



<pre> &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;11111111111111 1111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKL MNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/ TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 07- 01T13:40:23.467Z&lt;/Tr adDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/ TradgCpcty&gt; ... &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Am t&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/Trad Vn&gt; ... &lt;TradPlcMtchgld&gt;123 4&lt;/TradPlcMtchgld&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Algo&gt;ALGO12345&lt;/ Algo&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... </pre>	<pre> &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;88888888888888 8888888&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123 4567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/ TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23Z&lt;/TradD t&gt; &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt; /TradgCpcty&gt; ... &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Am t&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MAR IECLAIR&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; </pre>	<pre> &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234 567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19620604JEAN #COCTE&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry &gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/T rnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 07- 01T13:40:23Z&lt;/TradDt &gt; &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/ TradgCpcty&gt; ... &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Am t&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad Vn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;CA11122233344 45555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; </pre>	<pre> &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKL LMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;123456789012 34567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt; /TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018- 07- 01T13:40:23Z&lt;/Trad Dt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;MTCH &lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/A mt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Tra dVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;CA11122233344 45555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; </pre>
---	---	---	--

<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/ Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA111222333444 5555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt;  &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;CA111222333444 5555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt;  &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA11122233344 45555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---------------------------------------	--	--	---

Поле 25: Нито едно от дружествата не е предало поръчките, тъй като търгуват за собствена сметка или за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки и следователно попълват това поле с „false“.

Полета 26 и 27: Тези полета следва да се попълнят единствено от получаващ инвестиционен посредник, когато условията за подаване са спазени. Тъй като случаят не е такъв, те не са попълнени.

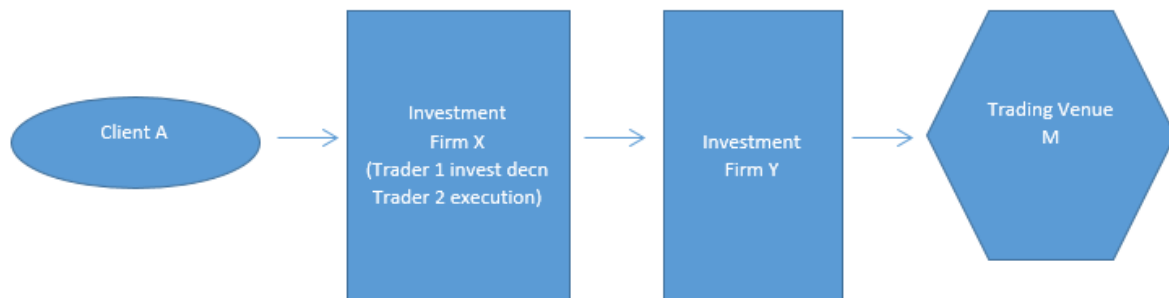
Времето и цените за всяка търгувана двойка за същата сделка следва да съответстват (напр. времето на сделката, отчетено от инвестиционен посредник Z с инвестиционен посредник Y следва да бъде същото като отчетеното от инвестиционен посредник Y с инвестиционен посредник Z) съгласно различните изисквания за ниво на детайлност за дружествата – вижте раздел 7.2 относно нивото на детайлност на удостоверението за време. Съгласно поле 28 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, единствено отчетът от страна на пазара на място на търговия трябва да бъде отчетен в съответствие с изискванията за ниво на детайлност, посочени в член 3 и таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията и така отчетите от X и Y трябва да бъдат изготвени само до секунди (въпреки че те могат да бъдат отчетени с по-високо ниво на детайлност). Инвестиционен посредник X може да отчете времето за изпълнение, което му е потвърдено от инвестиционен посредник Y. Времето и цената, които инвестиционен посредник X отчита за сделката с клиент 1, могат да бъдат различни от времето и цената, които инвестиционен посредник X отчита за сделката с инвестиционен посредник Y, защото разпределението до клиента за акции може да се случи по различно време от сделката с пазарния контрагент и може да бъде на различна цена.

### 5.26.2 Вериги, при които условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) са спазени, но не всички други условия, посочени в член 4, са спазени

Следните примери показват, че с изключение на поле 25, отчитането на вериги, където условията в член 4, параграф 1, букви а) и б) са изпълнени, но не всички други условия, посочени в член 4, са изпълнени, е по същество същото като за вериги, при които нито едно от условията съгласно член 4 не е изпълнено.

#### 5.26.2.1 Проста верига

##### Пример 65



Client A	Клиент А
Investment Firm X (Trader 1 invest decn Trader 2 execution)	Инвестиционен посредник X (Търговец 1 инв. решение) Търговец 2 изпълнение)
Investment Firm Y	Инвестиционен посредник Y
Trading Venue M	Място на търговия M

Търговец 1 взема решение да закупи финансов инструмент за клиент А съгласно неограничен мандат от клиент А и търговец 2 подава поръчка до инвестиционен посредник Y да закупи инструмента. Инвестиционен посредник Y, като извършва действия при търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки, изпълнява поръчката на място на търговия M на 1 юни 2018 г. в 14:51:09.123 ч. при цена 32,5 EUR като използва алгоритъм с идентификатор ALGO12345.

Място на търговия M определя идентификационен код на сделка: '1234'.

Как отчитат инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на сделката,	'1234'	

	зададен от мястото на търговия		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент A
12	Код на купувач, който взема решението		{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Y
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'true'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача		
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача		
28	Дата и време на търгуване	'01.06.2018 г., 14:51:09.123 ч.'	'01.06.2018 г., 14:51:09 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'MTCH'	'AOTC'
33	Цена	'32.5'	'32.5'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		{NATIONAL_ID} на търговец 1
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{Код на алгоритъма}	{NATIONAL_ID} на търговец 2

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник Y	Доклад от инвестиционен посредник X
<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buy&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;</pre>	<pre>&lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...    &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buy&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;</pre>

<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06- 01T14:51:09.123Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Algo&gt;ALGO12345&lt;/Algo&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;   &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;AcctOwnc&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;true&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06-01T14:51:09Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   ...   &lt;Othr&gt;   &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   ...   &lt;Othr&gt;   &lt;Id&gt;GBAB123456C&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; </pre>
---	---



Инвестиционен посредник Y не проучва инвестиционен посредник X до инвеститора и отчита инвестиционен посредник X като купувач. От друга страна, инвестиционен посредник X не проучва инвестиционен посредник Y до мястото и отчита мястото като 'XOFF'.

Поле 25 е определено на 'true' в отчета за сделка на инвестиционен посредник X, защото дружеството предава поръчка, въпреки че не изпълнява условията съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Поради същата причина, полета 26 и 27 са празни.

Ако инвестиционен посредник X не беше инвестиционен посредник и следователно предаването никога не би могло да бъде приложено, компетентният орган би получил единствено отчета на инвестиционен посредник Y.

#### 5.26.2.2 По-дълга верига

##### Пример 66

Примерът по-долу се основава на същия сценарий както описанието в началото на раздел 5.26, с изключение че инвестиционни посредници X, Y и Z извършват действия „във всяко друго качество“

N	Поле	Доклад със стойности инвестиционен посредник Z	Доклад със стойности инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на клиент A
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'true'	'true'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото			



<pre> &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt; ...   &lt;New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt; ...   &lt;New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---	---

Времето следва да бъде същото за всички отчети, попадащи в обхвата на различни изисквания за ниво на детайлност за дружествата – вижте раздел 7.2 относно нивото на детайлност на удостоверенията за време. Това е защото дружествата извършват действия във всяко друго свързано с търговия качество и следователно отчетите са за същата сделка. Единствено отчетът от страна на пазара на място на търговия трябва да бъде отчетен в съответствие с член 3 и таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията и така отчетите от X и Y следва единствено да бъдат изготвени до секунди (въпреки че те могат да бъдат отчетени с по-високо ниво на детайлност), инвестиционен посредник Y може да отчете времето за изпълнение, което му е потвърдено от инвестиционен посредник Z и дружество Ч може да отчете времето, което му е потвърдено от инвестиционен посредник Y.

Това отчитане е действително същото като за верига, където инвестиционните посредници извършват действия „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ с изключение на попълването на поле показател за предаване на поръчка, което се попълва като „true“ за предаващите дружества, които не отговарят на условията за предаване, но се попълва като „false“ за инвестиционни посредници, които извършват действия „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ и следователно не предават.

Без значение дали инструментът е дериватен инструмент, отчетите на инвестиционни посредници X и Y ще бъдат попълнени с 'XOFF' в поле 36, като тези отчети не са относно прякото изпълнение на мястото на търговия.

### 5.26.2.3 Вериги, които включват дружества, непопадащи в обхвата на Регламента за пазарите на финансови инструменти

#### 5.26.2.3.1 Поръчка, изпратена до дружество без задължение за отчитане

##### Пример 67

Инвестиционен посредник X взема инвестиционно решение съгласно неограничен мандат за покупка на подлежащ на отчитане инструмент за клиент А. Търговец 1 взема инвестиционното

решение, а търговец 2 е решил да изпрати поръчката на филиал на дружество Ч, дружество Ж, за изпълнение. Инвестиционен посредник Х извършва действия на база „всяко друго“ свързано с търговия качество. Дружество Ж е отделно юридическо лице, намиращо се в САЩ с LEI: GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник Х?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Х	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на клиент А	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
12	Код на купувач, който взема решението	{LEI} на инвестиционен посредник Х	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на дружество Ж	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr>
21	Код на продавач, който взема решението		<DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr>
25	Показател за предаване на нареждане	'вярно'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
36	Място на провеждане	'XOFF'	
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 1	<LEI>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG</LEI> > </Id> </AcctOwnr>
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 2	</Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn>



25	Показател за предаване на нареждане	False	<pre> &lt;Id&gt;   &lt;LEI&gt;88888888888888888888&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     ...     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
36	Място на провеждане	'XOFF'	
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 1	

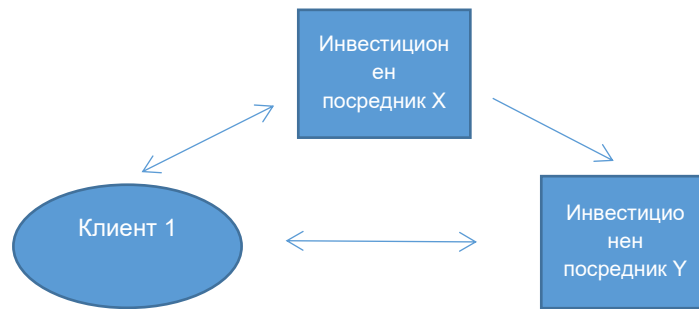
Инвестиционен посредник X не се изисква да проучва своя непосредствен клиент и дружество 3 не може да предава като изпълнява условията на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, тъй като не е инвестиционен посредник, така инвестиционен посредник X следва да отчете американския филиал, дружество 3, като купувач.

Дружество 3 не се отчита, тъй като не е инвестиционен посредник.

5.26.2.4 Инвестиционен посредник X и неговият клиент извършват действия съгласно неограничен мандат и са клиенти на изпълняващ инвестиционен посредник Y

#### Пример 69

При липсата на предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, когато дружество за управление на инвестиции извършва действия съгласно неограничен мандат инвестиционният посредник, който получава поръчката, следва да отчете дружеството, извършващо действия съгласно неограничен мандат, като купувач/продавач. Такъв е случая дори когато клиентът на дружество за управление на инвестиции също е клиент на получаващия инвестиционен посредник и без значение дали дружеството за управление на инвестиции, което извършва действия съгласно неограничен мандат, е инвестиционен посредник или дружество.



Клиент 1 е клиент на инвестиционен посредник Y и също клиент на инвестиционен посредник X.

Инвестиционен посредник X има неограничен мандат от клиент 1 и взема решение за покупка на определени финансови инструменти за клиент 1 и изпраща поръчка до инвестиционен посредник Y.

Инвестиционен посредник X не изпълнява условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Как инвестиционен посредник Y следва да отчита полето купувач/продавач?

Инвестиционен посредник Y следва да отчита инвестиционен посредник X като купувач, а не клиент 1.

### 5.26.3 Вериги, при които условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от всички инвестиционни посредници

Единствено информацията, посочена в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, трябва да бъде осигурена от предаващия инвестиционен посредник и единствено доколкото тя се отнася до дадената поръчка. Например, за финансов инструмент, търгуван на организирана платформа за търговия извън Съюза, където основният инструмент е финансов инструмент, търгуван на място на търговия, който няма ISIN, предаващият инвестиционен посредник не би осигурил ISIN, тъй като той не съществува и следователно не се отнася за поръчката. В допълнение, въпреки че предаващият инвестиционен посредник би осигурил информацията в полета 42-56, ако той самият отчиташе сделката, той не трябва да осигурява тази информация като част от данните за предаване, осигурени на получаващия инвестиционен посредник<sup>31</sup>. Всяка допълнителна информация, която се включва в отчета за сделка от получаващия инвестиционен посредник, следва да бъде попълнена от получаващия инвестиционен посредник от неговите собствени данни на базата на действителното изпълнение(я). Получаващият инвестиционен посредник следва да използва единствено информацията от предаващия инвестиционен посредник за отчитане на тези полета, посочени в приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

<sup>31</sup> Член 4, параграф 2, буква а) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията изисква единствено финансовия инструмент да бъде идентифициран от „код за идентифициране“.

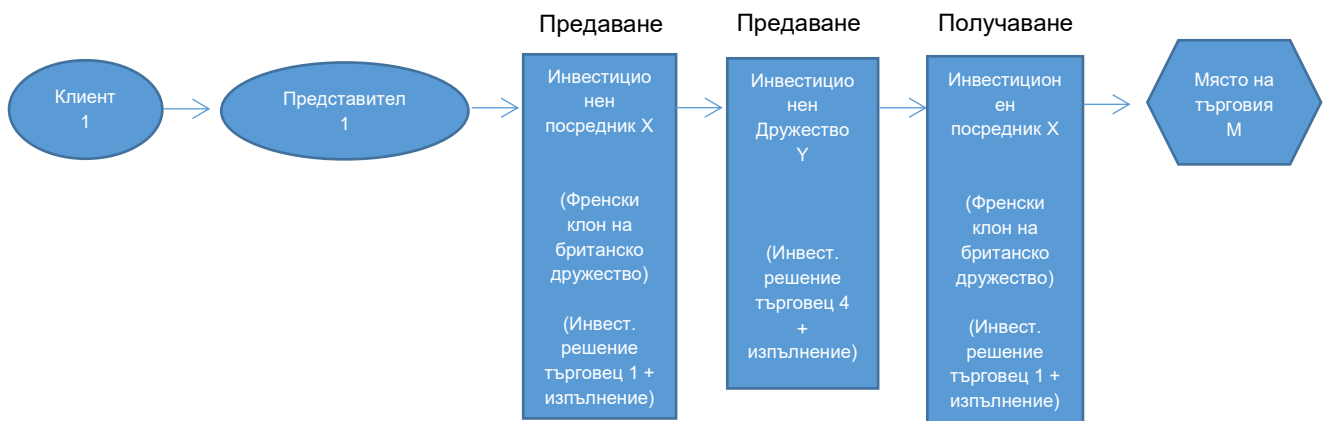
Цената и количеството, които се осигуряват от предаващия инвестиционен посредник, са цената и количеството на поръчката и цената и количеството на действителното изпълнение не трябва да бъдат потвърдени от предаващия инвестиционен посредник, освен когато има разпределения към повече от един клиент, като в този случай предаващият инвестиционен посредник ще трябва да осигури количествата, които да бъдат разпределени на всеки клиент.

Идентифицирането кой е купувача(ите)/продавача(ите), които да бъдат отчетени от получаващия инвестиционен посредник зависи единствено от това дали условията за предаване са спазени. По този начин, когато информацията относно разпределението(та) към клиента е осигурена по времето на поръчката, например за клиринг и сетълмент, но липсва споразумение за предаване или едно от условията за предаване не е изпълнено, получаващото дружество ще отчете инвестиционния посредник, който изпраща поръчката като купувач /продавач.

Обърнете внимание, че когато полетата, които са посочени като попълнени с информация от предаващия инвестиционен посредник (маркирани в зелено) са празни в примерите по-долу, това е защото предаващият инвестиционен посредник е предал като празно (което означава неприложимо).

Примерите по-долу показват информацията, която предаващият инвестиционен посредник трябва да осигури на получаващия инвестиционен посредник, която от тази информация получаващият инвестиционен посредник трябва да отчете от предадената информация, а не от своята собствена информация и как това е попълнено в неговите отчети. Посочва също, че дружеството, което се отчита в полето код за идентифициране на предаващото дружество за купувача/продавача е крайния предавач, а не предаващия инвестиционен посредник, който действително е предал информацията на получаващия инвестиционен посредник.

### Пример 70



Клиент 1 е клиент на инвестиционен посредник X. Лице, което извършва действия съгласно пълномощно за клиент 1, представител 1, решава да продаде 523 бр. стокови деривати, които принадлежат на клиент 1 за не по-малко от 31 EUR и инструктира френския клон на инвестиционен посредник X. Търговец 1, който е надзираван от британската централа на дружество Ч, приема поръчката от представител 1 и инструктира инвестиционен посредник Y. Търговец 4 решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник X и изпраща поръчката до инвестиционен посредник Z. Инвестиционен посредник Z е британско дружество. Търговец 5 решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник Y и търговец 6 изпраща поръчката до място на търговия M.



Поръчката е частично изпълнена в регистъра с поръчки на място на търговия М в 13:40:23.4672 ч. на 1 юли 2018 г. за 500 финансови инструмента при цена 32,50 EUR. Място на търговия определя идентификационен код на сделка: '1234'.

Стоковият дериват има ISIN: XX000000001.

Клиент 1 редуцира своя риск по обективно измерим начин в съответствие с член 57 на Директива 2014/65/ЕС.

Инвестиционни посредници X и Y удовлетворяват всички условия за предаване.

Инвестиционен посредник X следва да предостави на инвестиционен посредник Y:

- 1) Идентификационен код на финансовия инструмент: ISIN за финансовия инструмент (XX000000001)
- 2) Фактът, че поръчката е за продажба на финансовия инструмент
- 3) Цената и количеството на поръчката: 523 финансови инструмента за не по-малко от 31 EUR
- 4) Обозначение за продавача: национален идентификатор на клиент 1: Данни
- 5) Данни за клиент 1
  - а) Име и фамилия
  - б) Дата на раждане
- 6) Обозначение и данни на вземащия решение: национален идентификатор на клиент на представител 1, лично име, фамилия и дата на раждане на представител 1.
- 7) Обозначение за идентифициране на лице или алгоритъма, отговорен за инвестиционното решение в рамките на предаващото дружество (инвестиционен посредник X): прано (тъй като инвестиционното решение е взето извън дружеството - представител 1 е взел решението).
- 8) Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение: празно
- 9) Държава на клона на инвестиционен посредник X, който е получил поръчката от клиента: FR
- 10) Показател за стоков дериват: вярно
- 11) Код, идентифициращ предаващ инвестиционен посредник: LEI на инвестиционен посредник X

Тъй като инвестиционен посредник Y също предава, той следва да предаде на инвестиционен посредник Z същата информация както инвестиционен посредник X му е предоставил, включително кода идентифициращ предаващото инвестиционно дружество, който в този случай е LEI на инвестиционен посредник X.

Поле 27 следва да бъде попълнено с инвестиционен посредник X, тъй като инвестиционен посредник X накрая е предал информацията и тази информация ще бъде предадена на инвестиционен посредник Z от инвестиционен посредник Y.

За точки 1 и 4-10 по-горе информацията е същата, както би била отчетена от инвестиционен посредник X, ако той не отговаряше на условията за предаване и е изпратил свой собствен отчет за сделка.

За следните примери полетата, маркирани в зелено в отчета на инвестиционен посредник Z, са попълнени директно от информацията, осигурена от предаващия инвестиционен посредник, инвестиционен посредник Y.

Тъй като инвестиционни посредници X и Y изпълняват условията за предаване, те не следва да отчитат сделки.

#### 5.26.3.1 Получаващият инвестиционен посредник търгува за собствена сметка

Отчетът на инвестиционен посредник Z трябва да бъде както следва:

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'	
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Z
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Z
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{NATIONAL_ID} на клиент 1
17	Държава на клона за продавача		'FR'
18	Собствено(и) име(на) на продавач		'ЖАН'
19	Фамилия (и) на продавач		'КОКТО'
20	Продавач - дата на раждане		04.06.1962
21	Код на продавач, който взема решението		{NATIONAL_ID} за представител 1
22	Лице, което взема решението за предаване - собствено (и) име (на)		'ФАБИО'
23	Лице, което взема решението за предаване - фамилия (и)		'ЛУКА'
24	Лице, което взема решението за предаване - дата на раждане		11.10.1962



<pre> &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;88888888888888888888888888888888&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23.467Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;TradPlcMtchgld&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgld&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000001&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt; &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;F11234567890A&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JONES&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;   ...   &lt;RskRdcgTx&gt;&gt;false&lt;/RskRdcgTx&gt;   ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; </pre>	<pre> &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Prsn&gt;         &lt;FrstNm&gt;JEAN&lt;/FrstNm&gt;         &lt;Nm&gt;COCTEAU&lt;/Nm&gt;         &lt;BirthDt&gt;1962-06-04&lt;/BirthDt&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCTE&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/Prsn&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;CtryOfBrnch&gt;FR&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;DcsnMakr&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;FrstNm&gt;FABIO&lt;/FrstNm&gt;     &lt;Nm&gt;LUCA&lt;/Nm&gt;     &lt;BirthDt&gt;1962-10-11&lt;/BirthDt&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;ITABCDEF1234567890&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/DcsnMakr&gt; &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;TrnsmtgSellr&gt;12345678901234567890&lt;/TrnsmtgSellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;       &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23Z&lt;/TradDt&gt;       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;     &lt;Id&gt;XX000000001&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt; </pre>
---	---

<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;      &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JONES&lt;/Id&gt;     &lt;SchmeNm&gt;       &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;   &lt;RskRdcgTx&gt;&gt;true&lt;/RskRdcgTx&gt;   ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---------------------------------------	---

Поле 57: тъй като инвестиционен посредник Z търгува за собствена сметка, той взема инвестиционното решение и лицето, което взема решението в рамките на инвестиционен посредник Z (търговец 5), следва да бъде попълнено в отчета от страна на пазара в поле 57. Отчетът от страна на клиента се попълва от информацията, получена от предаващия инвестиционен посредник. В този пример, то следва да бъде празно, тъй като тази информация беше получена от инвестиционен посредник X като празна (като решението е взето от представител 1).

Поле 58: Въпреки че поръчката произтича от клон, решението беше взето от клиента (или негов представител) и следователно, полето е празно в отчета от страна на клиента.

Времето и цената следва да съответстват (съгласно различни изисквания за ниво на детайлност), но времето за отчет от страна на клиента би могло да бъде по-късно за отразяване на часа, когато клиентът е станал собственик. Единствено отчетът от страна на пазара от инвестиционен посредник Z трябва да бъде отчетен с ниво на детайлност до микросекунди. Отчетът от страна на клиента следва единствено да бъде изготвен до секунди (въпреки че инвестиционен посредник Z може да отчита до по-високо ниво на детайлност).

### 5.26.3.2 Получаващо дружество, което извършва действия „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки/всяко друго качество“

#### Пример 71

Ако получаващият инвестиционен посредник, дружество Ц, извършва действия за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, то трябва да отчита както следва:

N	Поле	Стойности	XML представителство
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... </pre>

4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	<ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty>
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Код за идентифициране на продавач	{NATIONAL_ID} на клиент 1	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
17	Държава на клона за продавача	'FR'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr>
18	Собствено(и) име(на) на продавач	'ЖАН'	<Id> <Prsn>
19	Фамилия (и) на продавач	'КОКТО'	<FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm>
20	Продавач - дата на раждане	04.06.1962	<BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr>
21	Код на продавач, който взема решението	{NATIONAL_ID} на представител 1	<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn>
22	Лице, което взема решението за предаване - собствено (и) име (на)	'ФАБИО'	</Id>
23	Лице, което взема решението за предаване - фамилия (и)	'ЛУКА'	<CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr>
24	Лице, което взема решението за предаване - дата на раждане	11.10.1974	<Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr>
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача		<Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm>
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача	{LEI} на инвестиционен посредник X	</Othr> </Prsn> </DcsnMakr>
28	Дата и време на търгуване	'01.07.2018 г., 13:40:23.467 ч.'	</Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>
29	Качеството, в което лицето търгува	'MTCH'	
30	Количество	500	<TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr>
33	Цена	'32.5'	</OrdTrnsmssn>
34	Валута на цената	'EUR'	<Tx>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	<TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty>
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	<Qty> <Unit>500</Unit>

57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение		
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID}	на търговец 6
64	Показател за стокови деривати	'true'	
			<pre> &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgid&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgid&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000001&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     ...   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JONES&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;   &lt;RskRdcgTx&gt;true&lt;/RskRdcgTx&gt;   ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Когато инвестиционен посредник Z извършва действия „във всяко друго качество“, отчетът за сделка ще бъде точно същия както отчета по-горе, с изключение че качеството, в което лицето търгува в поле 29 ще бъде отчетено като 'АОТС'.

### 5.26.3.3 Клиентът има задължения по докладване на сделките

#### Пример 72

Нека допуснем, че вместо клиент 1 клиентът е клиент А и е инвестиционен посредник. Клиент А следва да отчете цената и времето, които са му потвърдени от инвестиционен посредник Х. Като се допуска, че инвестиционен посредник Z извършва действия във „всяко друго качество“ или „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“, клиент А подава отчет за сделка със същата цена и време като отчета от инвестиционен посредник Z, съгласно изискванията за ниво на детайлност, както е посочено в раздел 7.2, тъй като инвестиционни посредници Х, Y и Z извършват действия във „всяко друго свързано с търговия качество“ и следователно това е една сделка. Ако инвестиционен посредник Z извършва действия за собствена сметка, цената и времето могат да се различават. Клиент А следва да идентифицира инвестиционен посредник Х като купувач, защото това е лицето, с което клиент А е търгувал.

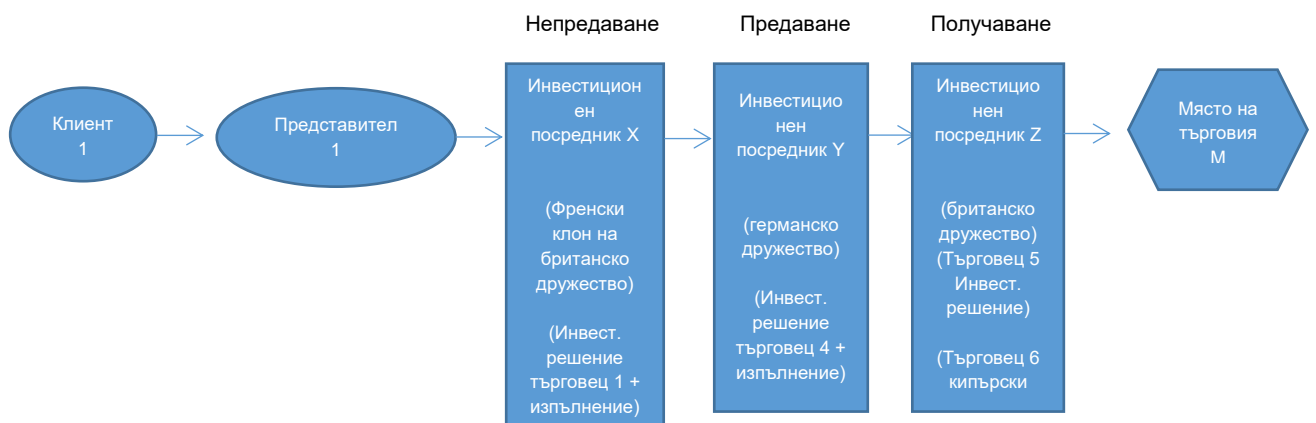
Отчитането от инвестиционен посредник Z следва да бъде същото, както в примерите в 5.26.3.2 (в зависимост от качеството, в което той търгува), с изключение, че той следва да идентифицира клиент А с неговия LEI код, като показателят за стокови деривати ще бъде попълнен с „false“.

#### 5.26.4 Вериги, при които условията, посочени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, са спазени от някои инвестиционни посредници във веригата

Примерът по-долу посочва, че предаващият инвестиционен посредник трябва да посочи дали той или друга страна е началния предаващ инвестиционен посредник.

##### 5.26.4.1 Инвестиционен посредник, който работи с краен клиент, не отговаря на условията за предаване

###### Пример 73



Клиент 1 е клиент на инвестиционен посредник X. Лице, което извършва действия съгласно пълномощно за клиент 1, представител 1, решава да продаде някои акции на клиент 1 и инструктира френския клон на инвестиционен посредник X. Търговец 1, който е надзиран от британската централа, решава да приеме поръчката от клиент 1 и решава да изпрати поръчката до инвестиционен посредник Y, германско дружество. Търговец 4 решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник Y и изпраща до инвестиционен посредник Z. Търговец 5 решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник Y и търговец 6, надзиран от кипърския клон на инвестиционен посредник Z, изпраща поръчката до място на търговия М. Инвестиционен посредник X и дружество Ш извършват действия във „всяко друго свързано с търговия качество“, а инвестиционен посредник Z извършва действия на база „търговия за собствена сметка“.

Поръчката е изпълнена в регистъра с поръчки на място на търговия М от инвестиционен посредник Z в 13:40:23.4672 ч. на 1 юли 2018 г. при цена 32,50 EUR. Място на търговия определя идентификационен код на сделка: '1234'. Инвестиционен посредник X избира да не предава данните на инвестиционен посредник Y.



Инвестиционен посредник Y предава данните на своя клиент (инвестиционен посредник X) и друга изисквана информация на инвестиционен посредник Z и изпълнява другите условия за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Инвестиционен посредник Y е германска фирма.

Клиент 1 извършва къса продажба.

Сделката е за акция с ISIN XX000000002.

Инвестиционен посредник Y следва да предостави на инвестиционен посредник Z:

- 1) Идентификационен код на финансовия инструмент; ISIN за инструмента XX000000002
- 2) Фактът, че поръчката е за продажба на финансовия инструмент
- 3) Цената и количеството на нареждането
- 4) Обозначение за продавача: LEI на инвестиционен посредник X. Това е защото инвестиционен посредник X не е предал данните на своя клиент (клиент 1) на инвестиционен посредник Y. Следователно, инвестиционен посредник Y ще разглежда инвестиционен посредник X като продавач, а не клиент 1.
- 5) Обозначение и данни на вземащия решение: празно
- 6) Показател за къса продажба: ПРОДАВА (Инвестиционен посредник X не извършва къса продажба)
- 7) Обозначение за идентифициране на лице или алгоритъма, отговорен за инвестиционното решение в рамките на предаващото дружество: празно (като решението е взето извън дружеството).
- 8) Държава на клона, който отговаря за лицето вземащо инвестиционното решение: празно (като решението е взето извън инвестиционно дружество Y).
- 9) Държава на клона на инвестиционен посредник Y, който е получил поръчката от клиента: DE (тъй като не участва клон, код на държава от 2 букви на централата на дружеството се попълва тук, в този случай това е германско дружество, така че това поле се попълва с 'DE').
- 10) Код, идентифициращ предаващ инвестиционен посредник: LEI на инвестиционен посредник Y

Тъй като инвестиционен посредник X не отговаря на условията за предаване, той следва да изпрати свой собствен отчет за сделка.

Тъй като инвестиционен посредник Y отговаря на условията за предаване, той не следва да изпрати отчет за сделка.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Z?

N	Поле	Доклад със стойности #1 на инвестиционен посредник Z	Доклад със стойности #2 на инвестиционен посредник Z	Доклад със стойности на инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на място на търговия	'1234'		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник X	{NATIONAL_ID} на клиент 1
17	Държава на клона за продавача		'DE'	'FR'
18	Собствено(и) име(на) на продавач			'ЖАН'
19	Фамилия (и) на продавач			'КОКТО'
20	Продавач - дата на раждане			04.06.1962
21	Код на продавач, който взема решението			{NATIONAL_ID} на представител 1
22	Лице, което взема решението за продаване - собствено (и) име (на)			'ФАБИО'
23	Лице, което взема решението за продаване - фамилия (и)			'ЛУКА'
24	Лице, което взема решението за продаване - дата на раждане			11.10.1974
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'	'true'
26	Код за идентифициране на предаващото			

	дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача		{LEI} на инвестиционен посредник Y	
28	Дата и време на търгуване	'01.07.2018 г., 13:40:23.467 ч.'	'01.07.2018 г., 13:40:23 ч.'	'01.07.2018 г., 13:40:23 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'AOTC'
33	Цена	'32.5'	'32.5'	'32.5'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	XOFF	XOFF
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	{ISIN} на инструмента	{ISIN} на инструмента
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 5		
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение	'GB'		
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 6	{NATIONAL_ID} на търговец 6	{NATIONAL_ID} на търговец 1
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'CY'	'CY'	'GB'
62	Показател за къса продажба	'SELL'	'SELL'	'SESH'

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Z От страна на пазара	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Z От страната на клиента	Доклад # 1 на Инвестиционен посредник X
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New>

<pre> &lt;ExctgPty&gt;8888888888888888 888888&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111 1&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;88888888888888888888 8&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdrTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-07-01T13:40:23.467Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;Id&gt;XX000000002&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt; &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FI1234567890A&lt;/Id&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPty&gt;8888888888888888 8888&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;88888888888888888888 &lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;DE&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;  &lt;TrnsmtgSellr&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/TrnsmtgSellr&gt; &lt;/OrdrTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-07-01T13:40:23Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;Id&gt;XX000000002&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt; &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNPOQR ST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;Prsn&gt; &lt;FrstNm&gt;JEAN&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;COCTEAU&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1962-06-04&lt;/BirthDt&gt; &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCTE E&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/Id&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;FR&lt;/CtryOfBrnch&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;DcsnMakr&gt; &lt;Prsn&gt;  &lt;FrstNm&gt;FABIO&lt;/FrstNm&gt; &lt;Nm&gt;LUCA&lt;/Nm&gt; &lt;BirthDt&gt;1962-10-11&lt;/BirthDt&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;ITABCDEF1234567890&lt;/Id&gt; &gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/DcsnMakr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdrTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; </pre>
---	--	--

<pre> &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;CY&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JONES&lt;/Id&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SELL&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;CtryOfBrnch&gt;CY&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JONES&lt;/Id&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;   ...  &lt;ShrtSellgInd&gt;SELL&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradDt&gt;2018-07-01T13:40:23Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000002&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	--

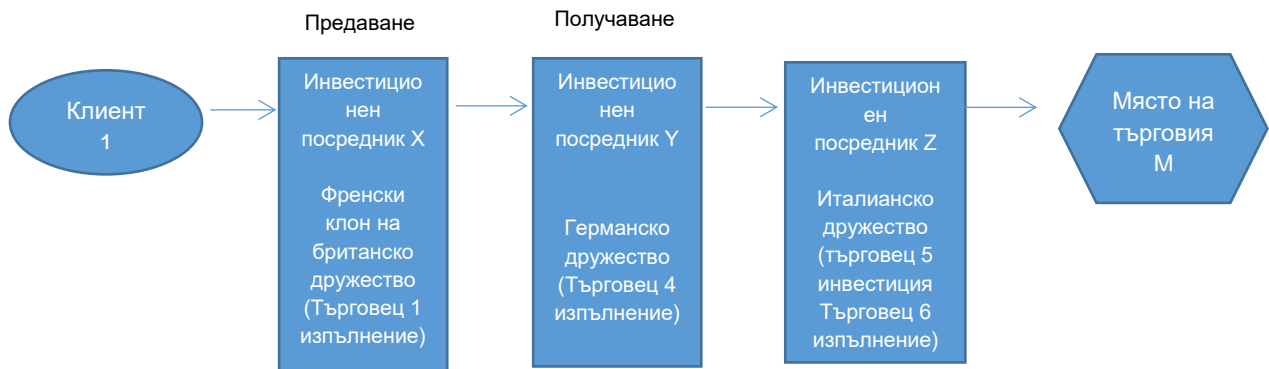
„Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача“ (поле 27) за продавача в отчетите за сделки от инвестиционен посредник Z е инвестиционен посредник Y, а не инвестиционен посредник X (като инвестиционен посредник X не е предал), тъй като инвестиционен посредник Y е посочил на инвестиционен посредник Z, че поръчката, която е изпратил до него, е била предадена от него от името на инвестиционен посредник X.

Полета 57 и 58 на отчет 2 (отчет от страна на клиента) са попълнени с информация, осигурена от инвестиционен посредник Y до инвестиционен посредник Z, който се отчита. И двете полета са празни, тъй като решението е взето от клиента. Обратно, полета 59 и 60 трябва да бъдат

попълнени със собствената информация на инвестиционен посредник Z и така търговец 6, който е надзиран от кипърския клон на инвестиционен посредник Z, е попълнен <sup>32</sup>.

#### 5.26.4.2 Инвестиционен посредник, който извършва действия като получаващо дружество и като предаващо дружество без да изпълнява условията за предаване

##### Пример 74



Клиент 1 е клиент на инвестиционен посредник X. Търговец 1, намиращ се във френския клон на инвестиционен посредник X, който извършва действия съгласно неограничен мандат осигурен от клиент 1, предоставя на инвестиционен посредник Y, германско дружество, поръчка за продажба на финансови инструменти. Търговец 1 е надзиран от британската централа на инвестиционен посредник X. Търговец 4 решава да приеме поръчката от дружество X и решава да изпрати поръчката до дружество Z. Търговец 5, който извършва действия за инвестиционен посредник Z, италианско дружество, решава да приеме поръчката от инвестиционен посредник Y и търговец 6 изпраща поръчката до място на търговия M.

Тогава поръчката е изпълнена в регистъра с поръчки на място на търговия M от инвестиционен посредник Z в 13:40:23.4672 ч. на 1 юли 2018 г. при цена 32,50 EUR. Място на търговия определя идентификационен код на сделка: '1234'.

Инвестиционен посредник X подава данните на клиент 1 и друга информация на инвестиционен посредник Y както е посочено по-долу и изпълнява другите условия за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Инвестиционен посредник Y избира да не предава данните на инвестиционен посредник Z. Инвестиционен посредник Z извършва действия в свързано с търговия качество „за собствена сметка“.

Сделката е в стоков дериват с ISIN XX000000003 и клиент 1 не намалява своя риск по обективно измерим начин в съответствие с член 57 от Директива 2014/65/ЕС;

Инвестиционен посредник X следва да предостави на инвестиционен посредник Y:

- 1) Идентификационен код на инструмента: ISIN за инструмента (XX000000003)

<sup>32</sup> Все пак обърнете внимание, че ако клиентът е взел решението то се попълва с „NORE“ (вижте раздел 5.12).

- 2) Фактът, че поръчката е за продажба на финансовия инструмент
- 3) Цената и к/количеството на нареждането
- 4) Обозначение за продавача: национален идентификатор на клиент 1
- 5) Данни за клиент 1
  - а) Собствено(и) име(на) и фамилия(и)
  - б) Дата на раждане
- 6) Обозначение и данни на вземащия решение: LEI за инвестиционен посредник X
- 7) Обозначение за идентифициране на лице или алгоритъма, отговорен за инвестиционното решение в рамките на предаващия инвестиционен посредник (инвестиционен посредник X): {NATIONAL\_ID} на търговец 1
- 8) Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение: GB
- 9) Държава на клона на инвестиционен посредник X, който е получил поръчката от клиента: FR
- 10) Код, идентифициращ предаващото дружество: LEI на инвестиционен посредник X
- 11) Показател за стоков дериват: грешен

Тъй като инвестиционен посредник Y не предава всички данни, той следва да изпрати свой собствен отчет за сделка.

Тъй като инвестиционен посредник X отговаря на условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, той не следва да подава отчет за сделка.

N	Поле	Доклад със стойности #1 на инвестиционен посредник Z	Доклад със стойности #2 на инвестиционен посредник Z	Доклад със стойности #1 на инвестиционен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Z
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Z	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{NATIONAL_ID} на клиент 1
17	Държава на клона за продавача		'IT'	'FR'
18	Собствено(и) име(на) на продавач			'ЖАН'
19	Фамилия (и) на продавач			'КОКТО'
20	Продавач - дата на раждане			04.06.1962

21	Код на продавач, който взема решението			{LEI} на инвестиционен посредник X
22	Лице, което взема решението за продаване - собствено (и) име (на)			
23	Лице, което взема решението за продаване - фамилия (и)			
24	Лице, което взема решението за продаване - дата на раждане			
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'	'true'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача			LEI на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'01.07.2018 г., 13:40:23.467 ч.'	'01.07.2018 г., 13:40:23.467 ч.'	'01.07.2018 г., 13:40:23 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'AOTC'
33	Цена	'32.5'	'32.5'	'32.5'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	{Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'	'XOFF'
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	{ISIN} на инструмента	{ISIN} на инструмента
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 5	{NATIONAL_ID} на търговец 5	{NATIONAL_ID} на търговец 1
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо	'IT'	'IT'	'GB'



	инвестиционно решение			
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 6	{NATIONAL_ID} на търговец 6	{NATIONAL_ID} на търговец 4
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'IT'	'IT'	'DE'
64	Показател за стокови деривати	'false'	'false'	'false'

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Z От страна на пазара	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Z От страната на клиента	Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;8888888888888888 88888&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;11111111111111111111 &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;88888888888888888888 &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;    &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt;   &lt;/OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23.467Z&lt;/TradDt&gt;    &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCp cty&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;8888888888888888 88888&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;88888888888888888888 &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OP QRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;    &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt;   &lt;/OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23.467Z&lt;/TradDt&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;88888888888888888888 &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Prsn&gt;   &lt;FrstNm&gt;JEAN&lt;/FrstNm&gt;   &lt;Nm&gt;COCTEAU&lt;/Nm&gt;   &lt;BirthDt&gt;1962-06-04&lt;/BirthDt&gt;   &lt;Id&gt;   &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCT E&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/Prsn&gt;    &lt;CtryOfBrnch&gt;FR&lt;/CtryOfBrnc h&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt; </pre>

<pre> ... &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/Trad PlcMtchgId&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000003&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt;   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FI1234567890A&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt; &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JON ES&lt;/Id&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;RskRdcgTx&gt;false&lt;/RskRdcg Tx&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCp cty&gt;   ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000003&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt;   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FI1234567890A&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;HU19800413ADAM#JON ES&lt;/Id&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;RskRdcgTx&gt;false&lt;/RskRdcg Tx&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdRTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/Trnsmssn Ind&gt;  &lt;TrnsmttgSellr&gt;123456789012 34567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt;   &lt;/OrdRTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-07- 01T13:40:23Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;   ...   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XX000000003&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt;   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnc h&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/I d&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;DE&lt;/CtryOfBrnc h&gt;   &lt;Othr&gt; </pre>
--	--	--

		<pre> &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;RskRdcgTx&gt;&gt;false&lt;/RskRdcg Tx&gt; ... &lt;/AddtlAttrbts&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	---

Инвестиционен посредник Y извършва действия като получаващ инвестиционен посредник (получаващ информация от инвестиционен посредник X, където условията за предаване са изпълнени) и също извършващ действия като предаващо инвестиционно дружество, което не отговаря на условията за предаване. Като такъв, инвестиционен посредник Y трябва да отчита сделка. Инвестиционен посредник Y следва да попълни поле 25 за посочване, че той предава без да изпълнява условията за предаване и поле 27 за посочване, че той е получил информация от инвестиционен посредник X, който е изпълнил условията за предаване до инвестиционен посредник Y. Също, поле 17 се попълва с информацията, получена от инвестиционен посредник X и следователно следва да бъде попълнено с клона на предаващия инвестиционен посредник, а не клона на получаващия инвестиционен посредник.

#### 5.26.4.3 Дружеството обобщава и отговаря на условията за предаване за някои поръчки, а за други не

##### Пример 75

Двама клиента на инвестиционен посредник X, клиент А и клиент Б, подават поръчки за продажба за 100 и 200 инструмента съответно.

Инвестиционен посредник X предава поръчките на инвестиционен посредник Y. Инвестиционен посредник X единствено изпълнява условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията за поръчка за клиент А. Инвестиционен посредник Y изпълнява обобщената поръчка от 300 инструмента при 25,54 EUR на 28 октомври 2018 г. в 11:23:45.1243ч. на място на търговия М. Инвестиционен посредник X и дружество Y тъгуват на база „всяко друго качество“.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойности	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New>

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<pre> &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-10- 28T11:23:45Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на клиент Б	
25	Показател за предаване на нареждане	'true'	
28	Дата и време на търгуване	'28.10.2018 г., 11:23:45 ч.'	
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	
30	Количество	'200'	
33	Цена	'25.54'	
36	Място на провеждане	'XOFF'	

Как трябва да докладва инвестиционен посредник Y?

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2	Доклад със стойности #3
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	'INTC'	'INTC'

16	Код за идентифициране на продавач	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на инвестиционен посредник X
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'	'false'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача		{LEI} на инвестиционен посредник X	
28	Дата и време на търгуване	'28.10.2018 г., 11:23:45.124 ч.'	'28.10.2018 г., 11:23:45.124 ч.'	'28.10.2018 г., 11:23:45.124 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'300'	'100'	'200'
33	Цена	'25.54'	'25.54'	'25.54'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'	'XOFF'

XML представителство:

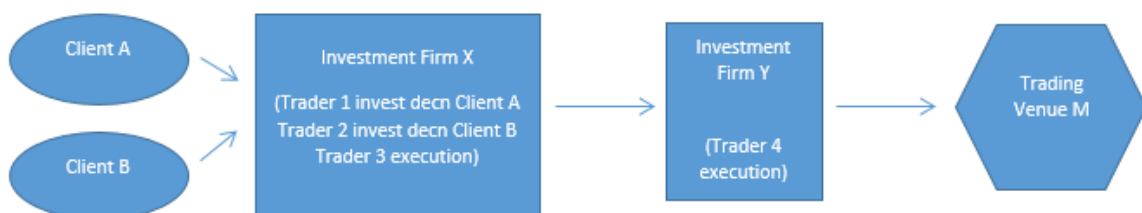
Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM   NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;11111111111111111111   &lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM   NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;       &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA   AAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM   MNOPQRST&lt;/ExctgPty&gt;   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;       &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;1234567890123456789   0&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; </pre>

<pre> &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;/OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-10-28T11:23:45.124Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;300&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;TrnsmttgSellr&gt;12345678901234567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt;   &lt;/OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-10-28T11:23:45.124Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;100&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;   &lt;/OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-10-28T11:23:45.124Z&lt;/TradDt&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;25.54&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; </pre>
---	---	---

## 5.27 Инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти

5.27.1 Инвестиционен посредник, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти без да изпълнява условията за предаване (комбинация от обобщени поръчки и вериги/предаване)

### Пример 76



Client A	Клиент А
Client B	Клиент Б
Investment Firm X	Инвестиционен посредник X
(Trader 1 invest decn Client A Trader 1 invest decn Client B Trader 3 execution)	(Търговец 1 инв. решение клиент А Търговец 1 инв. решение клиент Б Търговец 3 изпълнение)
Investment Firm Y	Инвестиционен посредник Y
(Trader 3 execution)	(Търговец 3 изпълнение)
Trading Venue M	Място на търговия М

Инвестиционен посредник X извършва действия за клиент А и клиент Б съгласно неограничени мандати. Търговец 1 решава да купи 400 единици от даден финансов инструмент за клиент А. Търговец 2 решава да купи 200 от същия финансов инструмент за клиент Б. Търговец 3 изпраща обобщената поръчка до инвестиционен посредник Y за изпълнение. Поръчката след това е изпълнена на място на търговия М, от търговец 4 в две изпълнения, едно на 24 юни 2018 г. в 14:25:30.1264 ч. за 350 инструмента при 30 EUR и едно на 24 юни 2018 г. в 15:55:40.3452 ч. за 250 инструмента при 32,5 EUR. Мястото на търговия предоставя идентификационни кодове на сделки '1234' и '6789' съответно за сделките.

Ако вместо това инвестиционен посредник X беше управляващо дружество, което управлява фонд и не е инвестиционен посредник, управляващото фонд дружество следва да бъде идентифицирано от инвестиционен посредник Y като купувач/продавач и полетата за вземаш решение не следва да бъдат попълнени, тъй като управляващото фонд дружество не е инвестиционен посредник, няма задължения за отчитане на сделка и не може да предава информация.

Начинът по който инвестиционен посредник X се отчита зависи от това как инвестиционен посредник Y потвърждава изпълненията на инвестиционен посредник X както е посочено по-долу.

По подобен начин, как клиент А и клиент Б биха се отчитали, ако бяха инвестиционни посредници, зависи от това как инвестиционен посредник X потвърждава изпълненията за тях.

Инвестиционен посредник X не изпълнява условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Инвестиционен посредник X извършва действия във „всяко друго“ свързано с търговия качество.

5.27.1.1 Инвестиционен посредник Y потвърждава всяко от своите изпълнения от страна на пазара до инвестиционен посредник X

Това следва да се случва, когато изпълняващият нарежданията посредник извършва действия във „всяко друго“ свързано с търговия качество или за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки.

Инвестиционен посредник Y извършва действия във „всяко друго“ свързано с търговия качество.

#### Пример 77

Сценарий, както е посочен в примера в 5.27.1 , където изпълняващият нарежданията посредник Y потвърждава всяко изпълнение на пазара на инвестиционен посредник X.

Инвестиционен посредник X трябва да се отчита, тъй като не отговаря на условията на предаване.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Стойности Доклад # 1 Инвестиционен посредник X	Стойности Доклад # 2 Инвестиционен посредник X	Стойности Доклад # 3 Инвестиционен посредник X	Стойности Доклад # 4 Инвестиционен посредник X	Стойности Доклад # 1 Инвестиционен посредник Y	Стойности Доклад # 2 Инвестиционен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия					'1234'	'6789'
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на Инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
12	Код на купувач, който взема решението			{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X		
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	'INTC'	'INTC'	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М
21	Код на продавач, който взема решението						



25	Показател за предаване на нареждане	'true'	'true'	'true'	'true'	'false'	'false'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача						
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача						
28	Дата и време на търгуване	'24.06.20 18 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.20 18 г., 15:55:40 ч.'	'24.06.20 18 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.20 18 г., 14:25:30 ч.'	'24.06.20 18 г., 14:25:30. 126 ч.'	'24.06.20 18 г., 15:55:40. 345 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'350'	'250'	'400'	'200'	350	250
33	Цена	'30'	'32.5'	'31.04166 67'	'31.04166 67'	30	32.5
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	EUR	EUR
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	Сегмент {MIC} на място на търговия M	Сегмент {MIC} на място на търговия M
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството			{NATION AL_ID} на търговец 1	{NATION AL_ID} на търговец 2		
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 4	{NATION AL_ID} на търговец 4

Обърнете внимание, че в отчети 3 и 4 на инвестиционен посредник X поле 12 идентифицира инвестиционен посредник X, тъй като инвестиционен посредник X извършва действия на дискреционна основа за клиенти А и Б. Самоличността на търговците, които са взели решението за клиенти А и Б, следва да бъде попълнена в поле 57.

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 3 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 4 на Инвестиционен посредник X
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;123456789     01234567890&lt;/ExctgP     ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN     OPQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/T     rnsmsnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-     06-     24T14:25:30Z&lt;/TradDt     &gt;     &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/     TradgCpcty&gt;     ...     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;350&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt     Ccy="EUR"&gt;30&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;           </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;123456789     01234567890&lt;/ExctgP     ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN     OPQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/T     rnsmsnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-     06-     24T15:55:40Z&lt;/TradDt     &gt;     &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/     TradgCpcty&gt;     ...     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt     Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Am     t&gt;     &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;           </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;123456789     01234567890&lt;/ExctgP     ty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAA     AAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;DcsnMakr&gt;     &lt;LEI&gt;1234567890123     4567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/DcsnMakr&gt;     &lt;Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/T     rnsmsnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-     06-     24T14:25:30Z&lt;/TradDt     &gt;     &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/     TradgCpcty&gt;     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;400&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;           </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;ExctgPty&gt;12345678     901234567890&lt;/Exct     gPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB     BBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;DcsnMakr&gt;     &lt;LEI&gt;123456789012     34567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/DcsnMakr&gt;     &lt;Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;     &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/     TrnsmssnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-     06-     24T14:25:30Z&lt;/TradD     t&gt;     &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;     /TradgCpcty&gt;     &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;           </pre>

<pre> &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;     &lt;Prsn&gt;       ...       &lt;Othr&gt;     &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;/Tx&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;     &lt;Prsn&gt;       ...       &lt;Othr&gt;     &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;/Tx&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.041667&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...  &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     ...     &lt;Othr&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;  &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt;    &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;  &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   &lt;Othr&gt;   ...   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt;  &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.041667&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...  &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     ...     &lt;Othr&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   ...   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt;  &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	---	---

Доклад #1 на инвестиционен посредник У	Доклад #2 на инвестиционен посредник У
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;   ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt; </pre>

<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06-24T14:25:30.126Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt; &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;350&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;30&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt; &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06-24T15:55:40.345Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt; &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;6789&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--

Инвестиционен посредник X следва да отчита сделката „от страна на пазара“ с инвестиционен посредник Y освен разпределенията към клиента.

Инвестиционен посредник X отчита всяка от сделките, които са му потвърдени от инвестиционен посредник Y в съвкупна клиентска сметка 'INTC' и след това отчита движението от съвкупната сметка до клиентите.

Ако инвестиционен посредник Y извършва действия за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, отчитането следва да бъде същото с изключение, че свързаното с търговия качество в отчетите на инвестиционен посредник Y би било попълнено със свързано с търговия качество 'MTCN' в поле 29.

#### 5.27.1.2 Инвестиционен посредник Y потвърждава изпълнената сделка на инвестиционен посредник X

Това следва да се случва, когато изпълняващият нарежданията посредник Y извършва действия в свързано с търговия качество „за собствена сметка“.

#### Пример 78

Сценарият е както е посочено в примера в 5.27.1 по-горе, но инвестиционен посредник Y потвърждава изпълнената сделка на инвестиционен посредник X, а не отделни изпълнения на пазара. Часът следва да бъде часа на второто изпълнение или по-късно за отразяване на часа, когато е направил разпределението на инвестиционен посредник Y. Например, Y потвърждава на инвестиционен посредник X, че е купил 600 акции при цена 31.0416667 на 24.06.2018 г. в 16:06:20.34 ч.

Инвестиционен посредник X трябва да се отчита, тъй като не отговаря на условията на предаване.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Стойнос	Стойнос	Стойнос	Стойнос	Стойнос	Стойност
		ти Доклад # 1 Инвестиц ионен посредни к X	ти Доклад # 2 Инвестиц ионен посредни к X	ти Доклад # 3 Инвестиц ионен посредни к X	ти Доклад # 1 Инвестиц ионен посредни к Y	ти Доклад # 2 Инвестиц ионен посредни к Y	и Доклад # 3 Инвестиц ионен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия				'1234'	'6789'	
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X

12	Код на купувач, който взема решението		{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X			
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	'INTC'	'INTC'	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Y
21	Код на продавач, който взема решението						
25	Показател за предаване на нареждане	'true'	'true'	'true'	'false'	'false'	'false'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача						
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача						
28	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 16:06:20 ч.'	'24.06.2018 г., 16:06:20 ч.'	'24.06.2018 г., 16:06:20 ч.'	'24.06.2018 г., 14:25:30.126 ч.'	'24.06.2018 г., 15:55:40.345 ч.'	'24.06.2018 г., 16:06:20 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	'600'	'400'	'200'	'350'	'250'	'600'
33	Цена	'31.0416667'	'31.0416667'	'31.0416667'	'30'	'32.5'	'31.0416667'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	Сегмент {MIC} на място на търговия M	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'

57	Инвестиционн о решение в рамките на дружеството		{NATION AL_ID} на търговец 1	{NATION AL_ID} на търговец 2	{NATION AL_ID} на търговец 4	{NATION AL_ID} на търговец 4	{NATIONA L_ID} на търговец 4
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 3	{NATION AL_ID} на търговец 4	{NATION AL_ID} на търговец 4	{NATIONA L_ID} на търговец 4

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 3 на Инвестиционен посредник X
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQPQ RST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/TrnsmssnI nd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T16:06:20Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;600&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/TrnsmssnI nd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T16:06:20Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCp cty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;400&lt;/Unit&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678901234 567890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/Trnsmss nInd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T16:06:20Z&lt;/TradDt&gt; &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/Tradg Cpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt; </pre>

<pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.0416667&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.0416667&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt; &gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; ... &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.0416667&lt;/A mt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/ Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; ... &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;BE12345678901&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 3 на Инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHJKLMN NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHJKLMN NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; &lt;New&gt; ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHJKLMN MNOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; </pre>



<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNO PQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111 &lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T14:25:30.126.Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpc ty&gt; &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;350&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;30&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPl cMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; ... &lt;/Prsn&gt; </pre>	<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNO PQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; ... &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111 &lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:55:40.345Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpc ty&gt; &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;250&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;32.5&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;6789&lt;/TradPl cMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; ... </pre>	<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNO PQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt; &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T16:06:20Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgC pcty&gt; &lt;Qty&gt; &lt;Unit&gt;600&lt;/Unit&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;MntryVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;31.0416667&lt;/A mt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR R&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; ... &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; </pre>
---	--	---

<pre> &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	--

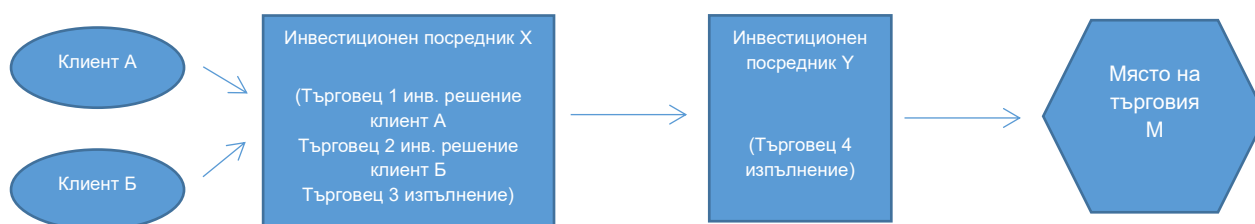
Както е посочено по-горе, инвестиционен посредник X следва да отчита сделки „от страна на пазара“ с инвестиционен посредник Y освен разпределенията към клиента.

Тъй като инвестиционен посредник Y търгува за собствена сметка той потвърждава попълнената съвкупна сума на дружество X, така че инвестиционен посредник X отчита сделка за съвкупната сума в съвкупна клиентска сметка 'INTC' и след това отчита движението от тази сметка до клиентите.

Ако инвестиционен посредник X обобщава поръчки и единствено изпълнява условията за предаване за някои поръчки, а за други не, вижте раздел 5.26.4.3.

### 5.27.2 Мениджър на инвестиции, който извършва действия съгласно неограничен мандат за множество клиенти и отговаря на условията за предаване

#### Пример 79



Търговец 1, надзираван от инвестиционен посредник X, дружество, което извършва действия съгласно неограничен мандат за клиенти 1 и 2, решава да продаде 500 акции за клиент 1 и търговец 2, надзираван от инвестиционен посредник X, решава да продаде 200 акции за клиент 2. Търговец 3, надзираван от инвестиционен посредник X, изпраща съвкупната поръчка за 700 акции до инвестиционен посредник Y. Търговец 4, надзираван от инвестиционен посредник Y, приема поръчката и я изпълнява на място на търговия M при едно изпълнение на 24 юни 2018 г. в 13:20:52.1456 ч. при цена 21 EUR.

Инвестиционен посредник X е британско дружество, а инвестиционен посредник Y е италианско дружество.

Клиент 1 извършва къса продажба, клиент 2 не. Инвестиционен посредник Y беше равен преди да продава на пазара и следователно осъществява къса продажба по времето на изпълнение на пазара.

Инвестиционен посредник X подава данните на клиент 1 и клиент 2 и друга информация на инвестиционен посредник Y както е посочено по-долу и изпълнява другите условия за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията.

Инвестиционен посредник X следва да предостави на инвестиционен посредник Y:

- 1) Идентификационен код на финансовия инструмент; ISIN за инструмента
- 2) Фактът, че поръчката е за продажба на финансовия инструмент
- 3) Цена и количество на поръчката: пазарна цена за 700 акции
- 4) Обозначение и данни на вземащия решение: LEI на инвестиционен посредник X
- 5) Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение: GB
- 6) Държава на клона на инвестиционен посредник X, който е взел инвестиционното решение Великобритания
- 7) Код, идентифициращ предаващото дружество: LEI на инвестиционен посредник X

Инвестиционен посредник X впоследствие осигурява (следното изпълнение, но в рамките на времето, разрешено съгласно споразумението за предаване):

- 8) Разпределения за клиент 1 и клиент 2
- 9) Обозначение за продавачите: национален идентификатор на клиент 1 и национален идентификатор на клиент 2
- 10) Данни за клиент 1
  - а) Собствено(и) име(на) и фамилия(и)
  - б) Дата на раждане
- 11) Показател за къса продажба за клиент 1: SESH (Клиент 1 извършва къса продажба)
- 12) Обозначение за идентифициране на лице или алгоритъм, отговорно/отговорен за инвестиционното решение в рамките на дружеството за клиент 1: {NATIONAL\_ID} на търговец 1
- 13) Данни за клиент 2
  - а) Собствено(и) име(на) и фамилия(и)

b) Дата на раждане

14) Показател за къса продажба за клиент 2: SELL (Клиент 2 не извършва къса продажба)

15) Обозначение за идентифициране на лице или алгоритъм, отговорно/отговорен за инвестиционното решение в рамките на дружеството за клиент 2: {NATIONAL\_ID} на търговец 2

Инвестиционен посредник Y извършва действия за собствена сметка и „прехвърля ценните книжа на инвестиционен посредник X в 15:00:12:51 ч. в същия ден.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник Y?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #3 Инвестиционен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
12	Код на купувач, който взема решението			
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{NATIONAL_ID} на клиент 1	{NATIONAL_ID} на клиент 2
18	Собствено(и) име(на) на продавач		'ЖАН'	'ХОСЕ ЛУИС'
19	Фамилия (и) на продавач		'КОКТО'	'РОДРИГЕС ДЕ ЛА ТОРЕ'
20	Продавач - дата на раждане		04.06.1962	27.02.1976
21	Код на продавач, който взема решението		{LEI} на дружество X	{LEI} на дружество X
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'	'false'

26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача		{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 13:20:52.1456 ч.'	'24.06.2018 г., 15:00:12 ч.'	'24.06.2018 г., 15:00:12 ч.'
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Количество	700	500	200
33	Цена	21	21	21
34	Валута на цената	EUR	EUR	EUR
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 1	{NATIONAL_ID} на търговец 2
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение	'IT'	'GB'	'GB'
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 4
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'IT'	'IT'	'IT'
62	Показател за къса продажба	'SESH'	'SESH'	'SELL'

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 3 на Инвестиционен посредник Y
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...

<pre> &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;11111111111111111111 &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpc ty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;700&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgld&gt;1234&lt;/TradPl cMtchgld&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;     &lt;Prsn&gt;  &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch &gt;   &lt;Othr&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Prsn&gt;  &lt;FrstNm&gt;JEAN&lt;/FrstNm&gt;  &lt;Nm&gt;COCTEAU&lt;/Nm&gt;   &lt;BirthDt&gt;1962-06- 04&lt;BirthDt&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCT E&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt;  &lt;TrnsmttgSellr&gt;123456789012 34567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpc ty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt; </pre>	<pre> &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;Prsn&gt;     &lt;FrstNm&gt;JOSE, LUIS&lt;/FrstNm&gt;     &lt;Nm&gt;RODRIGUEZ DE LA TORRE&lt;/Nm&gt;     &lt;BirthDt&gt;1976-02- 27&lt;/BirthDt&gt;     &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;ES99156722T&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   ...   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123456789 0&lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/Trnsmss nInd&gt;  &lt;TrnsmttgSellr&gt;12345678901 234567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt;   &lt;/OrdTrnsmssn&gt;   &lt;Tx&gt;     &lt;TradDt&gt;2018-06- 24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgC pcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt; </pre>
---	--	--

<pre> &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   ... &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch&gt; &gt;   &lt;Othr&gt; </pre>	<pre>   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;    &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt; </pre>	<pre>   &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;    &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt; </pre>
<pre> &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>   &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;    &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;    &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &gt;    &lt;Othr&gt; </pre>	<pre>   &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;    &lt;Id&gt;GBAB123456C&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;    &lt;CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt; </pre>
<pre>   &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR   &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;  &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>   &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR   &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;    &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>   &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR   &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;    &lt;ShrtSellgInd&gt;SELL&lt;/ShrtSellgInd&gt;   ...   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

Ако вместо това инвестиционен посредник Y извършваше действия на база „всяко друго свързано с търговия качество“, как инвестиционен посредник Y следва да се отчети?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #3 Инвестиционен посредник Y
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'		
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	'INTC'	'INTC'
12	Код на купувач, който взема решението			
16	Код за идентифициране на продавач	'INTC'	{NATIONAL_ID} на клиент 1	{NATIONAL_ID} на клиент 2
18	Собствено(и) име(на) на продавач		'ЖАН'	'ХОСЕ ЛУИС'
19	Фамилия (и) на продавач		'КОКТО'	'РОДРИГЕС ДЕ ЛА ТОРЕ'
20	Продавач - дата на раждане		04.06.1962	27.02.1976
21	Код на продавач, който взема решението		{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'	'false'
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача			
27	Код за идентифициране на предаващото дружество за продавача		{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
28	Дата и време на търгуване	'24.06.2018 г., 13:20:52.1456 ч.'	'24.06.2018 г., 13:20:52.1456 ч.'	'24.06.2018 г., 13:20:52.1456 ч.'



29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Количество	'700'	'500'	'200'
33	Цена	'21'	'21'	'21'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		{NATIONAL_ID} на търговец 1	{NATIONAL_ID} на търговец 2
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение	'IT'	'GB'	'GB'
59	Изпълнение в рамките на дружеството	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 4	{NATIONAL_ID} на търговец 4
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението	'IT'	'IT'	'IT'
62	Показател за къса продажба		'SESH'	'SELL'

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 3 на Инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;11111111111111111111 &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM NOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST&lt;/ExctgPty&gt; ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt; </pre>

<pre> &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;IntI&gt;INTC&lt;/IntI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06-24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;700&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;  &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ...   &lt;ExctgPrsn&gt;     &lt;Prsn&gt;       CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch&gt;     &lt;Othr&gt;&lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt; &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Prsn&gt;  &lt;FrstNm&gt;JEAN&lt;/FrstNm&gt;  &lt;Nm&gt;COCTEAU&lt;/Nm&gt;   &lt;BirthDt&gt;1962-06-04&lt;/BirthDt&gt;   &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCTE E&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;  &lt;TrnsmttgSellr&gt;12345678901234567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06-24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;500&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... </pre>	<pre> &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Prsn&gt;         &lt;FrstNm&gt;JOSE,         LUIS&lt;/FrstNm&gt;         &lt;Nm&gt;RODRIGUEZ         DE LA TORRE&lt;/Nm&gt;         &lt;BirthDt&gt;1976-02-27&lt;/BirthDt&gt;         &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;ES99156722T&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;DcsnMakr&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;   &lt;/DcsnMakr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   &lt;OrdTrnsmssn&gt;  &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;  &lt;TrnsmttgSellr&gt;12345678901234567890&lt;/TrnsmttgSellr&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   &lt;TradDt&gt;2018-06-24T15:00:12Z&lt;/TradDt&gt;  &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;200&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;21&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;  &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ...   &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt; </pre>
--	--	--

	<pre> &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;    CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnch&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;Othr&gt;    &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;   &gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;   ...   &lt;Othr&gt;    &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR   &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;    &lt;ShrtSellgInd&gt;SESH&lt;/ShrtSell   gInd&gt;   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;CtryOfBrnch&gt;GB&lt;/CtryOfBr nch&gt;   &lt;Othr&gt;    &lt;Id&gt;GBAB123456C&lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;     &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;    CtryOfBrnch&gt;IT&lt;/CtryOfBrnc h&gt;   &lt;Othr&gt;   &lt;Othr&gt;   &lt;Id&gt;FR19631202MARIECLAIR   &lt;/Id&gt;   &lt;SchmeNm&gt;   &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;   &lt;/SchmeNm&gt;   &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   &lt;AddtlAttrbts&gt;    &lt;ShrtSellgInd&gt;SELL&lt;/ShrtSel   lgInd&gt;   &lt;/AddtlAttrbts&gt;   &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--

Ако инвестиционен посредник Y извършваше действия за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки, то отчетите щяха да бъдат същите като гореспоменатите, с изключение че свързаното с търговия качество би било попълнено с 'MTCH'.

## 5.28 Пряк електронен достъп (ПЕД)

Доставчикът и клиентът за ПЕД, ако той е инвестиционен посредник, следва да подадат отчет за сделката (съгласно изключението, споменато във вариант Б).

При отчитане на сделка, доставчикът за ПЕД следва да гарантира да се идентифицира като изпълняващ субект (поле 4 „Идентификационен код на изпълняващия субект“). Тъй като ползващият ПЕД (клиентът) решава как да изпълни сделката, следва той да попълни полето „Изпълнение в рамките на дружеството“ с „NORE“, както е посочено в **Error! Reference source not found.** Доставчикът за ПЕД не следва да попълва поле 57 („Инвестиционно решение в рамките на дружеството“), тъй като никога не участва в инвестиционното решение, което е отговорност на клиента за ПЕД. Освен това, доставчик за ПЕД следва да се отчита като

извършващ действия във „всяко друго свързано с търговия качество“ или „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ (поле 29).

В своя отчет за сделка, клиентът за ПЕД следва да идентифицира доставчика за ПЕД, а не пазара като купувача (поле 7 - „Код за идентифициране на купувач“) или продавача (поле 16 - „Код за идентифициране на продавач“) както е приложимо. Освен това, той следва винаги да попълва поле 36 („Място“) като ‘XOFF’ тъй като той не е пряко участващо на пазара дружество. Все пак, подчертано е, че когато клиентът за ПЕД извършва действия от името на клиент и когато е предал данните на този клиент съгласно условията, предвидени в член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, клиентът за ПЕД не следва да отчита сделка тъй като цялата значима информация за сделката ще бъде предоставена на компетентния орган посредством отчета за сделка на доставчика за ПЕД.

### 5.28.1 Сценарий 1: клиентът за ПЕД търгува за собствена сметка без основен клиент

#### Пример 80

Инвестиционен посредник X (клиент за ПЕД) използва кода за членство на инвестиционен посредник Y (доставчик за ПЕД) за подаване на поръчка на място на търговия M. Поръчката на инвестиционен посредник X се състои от купуване на финансови инструменти на място на търговия M. В рамките на инвестиционен посредник X, търговец 1 е взел инвестиционното решение, като търговец 2 отговаря за подаване на поръчката за изпълнение чрез споразумение за ПЕД, осигурено от инвестиционен посредник Y. Място на търговия M генерира идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC) като ‘1234’..

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	‘1234’	
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
12	Код на купувач, който взема решението		
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Y
21	Код на продавач, който взема решението		

25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'false'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		{NATIONAL_ID} на търговец 1
59	Изпълнение в рамките на дружеството	'NORE'	{NATIONAL_ID} на търговец 2

XML представителство:

<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;       &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;     &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt;   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;ExctgPrsn&gt;     &lt;Clnt&gt;NORE&lt;/Clnt&gt;   &lt;/ExctgPrsn&gt;   ... &lt;/New&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;     ...     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     &lt;OrdTrnsmssn&gt;       &lt;TrnsmssnInd&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt;     &lt;/OrdTrnsmssn&gt;     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt;       ...       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...     &lt;InvstmtDcsnPrsn&gt;       &lt;Prsn&gt;         ...         &lt;Othr&gt;           &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;           &lt;SchmeNm&gt;             &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;           ...         &lt;/Othr&gt;       &lt;/Prsn&gt;     &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt;   &lt;/New&gt; </pre>
--	--

<pre>&lt;/Tx&gt;</pre>	<pre> &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/InvstmtDcsnPrsn&gt; &lt;ExctgPrsn&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt; &lt;Id&gt;GBAB123456C&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt; &lt;Cd&gt;NIDN&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
------------------------	--

При този сценарий, в рамките на инвестиционен посредник X, търговецът, който взема инвестиционното решение, е различен от търговеца, който подава поръчката за изпълнение. Когато само един търговец отговаря за инвестиционното решение и изпълнението в рамките на инвестиционен посредник X, то полета 57 и 59 от отчетите на дружество X следва да бъдат попълнени с националния идентификационен код на този търговец.

## 5.28.2 Сценарий 2: Клиент за ПЕД извършва действия от името на клиент

### 5.28.2.1 Вариант А: липсва предаване на данни на клиента до доставчик за ПЕД

#### Пример 81

Инвестиционен посредник X (клиент за ПЕД) използва кода за членство на инвестиционен посредник Y (доставчик за ПЕД) за подаване на поръчка на място на търговия M. Поръчката на инвестиционен посредник X се състои от купуване на финансови инструменти на място на търговия M. Инвестиционен посредник X извършва действия от името на клиент 1, чиито данни не са предадени на инвестиционен посредник Y. Клиент 1 е взел инвестиционното решение. В рамките на инвестиционен посредник X, търговец 1 отговаря за подаването на поръчка за изпълнение чрез споразумение за ПЕД, осигурено от инвестиционен посредник Y. Място на търговия M генерира TVTIC 1234.

Как трябва да докладват инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник X
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'	
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник X

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{NATIONAL_ID} на клиент 1
12	Код на купувач, който взема решението		
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник Y
21	Код на продавач, който взема решението		
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	'true'
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	'AOTC'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		
59	Изпълнение в рамките на дружеството	'NORE'	{NATIONAL_ID} на търговец 1

XML представителство:

Доклад #1 на инвестиционен посредник Y (доставчик за ПЕД)	Доклад #2 на инвестиционен посредник X (клиент за ПЕД)
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdrTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;&gt;false&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdrTrnsmssn&gt; &lt;Tx&gt;   ...   &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt;   ...   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt; ... &lt;Buyr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;Prsn&gt;         ...         &lt;Othr&gt;           &lt;Id&gt;FR19620604JEAN#COCTE&lt;/Id&gt;           &lt;SchmeNm&gt;             &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;           &lt;/SchmeNm&gt;         &lt;/Othr&gt;       &lt;/Prsn&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt; </pre>

<pre> &lt;TradPlcMtchgId&gt;1234&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Clnt&gt;NORE&lt;/Clnt&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;OrdTrnsmssn&gt;   &lt;TrnsmssnInd&gt;true&lt;/TrnsmssnInd&gt; &lt;/OrdTrnsmssn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;ExctgPrsn&gt;   &lt;Prsn&gt;     ...     &lt;Othr&gt;       &lt;Id&gt;CA1112223334445555&lt;/Id&gt;       &lt;SchmeNm&gt;         &lt;Cd&gt;CCPT&lt;/Cd&gt;       &lt;/SchmeNm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/Prsn&gt; &lt;/ExctgPrsn&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

### 5.28.2.2 Вариант Б: предаване на данни на клиента до доставчик за ПЕД

#### Пример 82

Инвестиционен посредник X (клиент за ПЕД) използва кода за членство на инвестиционен посредник Y (доставчик за ПЕД) за подаване на поръчка на място на търговия M. Поръчката на инвестиционен посредник X се състои от купуване на финансови инструменти на място на търговия M. Инвестиционен посредник X извършва действия от името на клиент 1, чиито данни са предадени на инвестиционен посредник Y съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията. Място на търговия M генерира TVTIC 1234. Тъй като инвестиционен посредник X отговаря на условията за предаване съгласно член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, той не следва да изготвя отчет за сделка.

Как трябва да докладва инвестиционен посредник Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y	XML представителство
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'1234'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ... </pre>

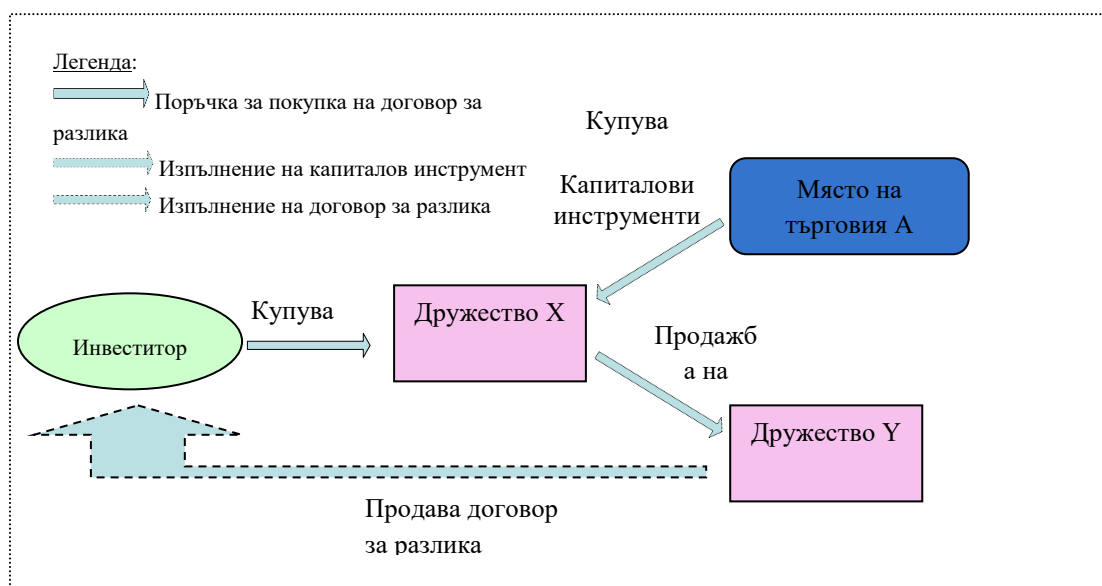


4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty>
7	Код за идентифициране на купувач	{NATIONAL_ID} на клиент 1	... <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn>
12	Код на купувач, който взема решението		... <Othr>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm>
21	Код на продавач, който взема решението		</Othr> </Prsn>
25	Показател за предаване на нареждане	'false'	</Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
26	Код за идентифициране на предаващото дружество за купувача	{LEI} на инвестиционен посредник X	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
29	Качеството, в което лицето търгува	'AOTC'	</Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	<TrnsmttgBuyr>12345678901234567890</TrnsmttgBuyr>
57	Инвестиционно решение в рамките на дружеството		</OrdTrnsmssn> <Tx>
58	Държава на клона, който отговаря за лицето, вземащо инвестиционно решение		... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn>
59	Изпълнение в рамките на дружеството	'NORE'	<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt>
60	Държава на клона, който осъществява надзор на лицето, отговарящо за изпълнението		</ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

## 5.29 Хеджиране посредством договори за разлика (ДР)

### Пример 83

Клиент 1 дава поръчка на инвестиционен посредник X за договори за разлика (ДР) върху конкретна основна акция (напр. Vodafone). ISIN кодът на основния капиталов инструмент е GB00BN4HKS39. Инвестиционен посредник X купува акцията на място на търговия М (за придобиване на хеджа) и предава тази сделка (продава акцията) на инвестиционен посредник Y (негов основен брокер), който след това сключва договора за разлика директно с клиент 1. Инвестиционни посредници X и Y извършват действия за собствена сметка.



При този сценарий, инвестиционен посредник X и дружество Ш следва да имат задължения за отчитане на сделки тъй като са изпълнили сделките: Инвестиционен посредник X купува и продава акцията, а инвестиционен посредник Y купува акцията и продава договора за разлика на клиент 1.

Как трябва да се отчетат инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник Y	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник Y <sup>33</sup>
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y

<sup>33</sup> Допълнителна информация относно отчитането на договори за разлика можете да прочетете в раздел 5.35.4.

7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{NATIONAL_ID} на клиент 1
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия M	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	'XOFF'	'XOFF'	'XXXX'
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на акции на Vodafone	{ISIN} на акции на Vodafone	{ISIN} на акции на Vodafone	
42	Пълно наименование на инструмента				'VODAFONE CFD'

XML представителство:

Доклад # 1 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник X	Доклад # 1 на Инвестиционен посредник Y	Доклад # 2 на Инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgPty&gt; y&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234 567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;111111111111111 111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;123456789 01234567890&lt;/ExctgPty&gt; y&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234 567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEF GHIJKLMNOPQRST &lt;/ExctgPty&gt; y&gt; ... &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN OPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;123456789012 34567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEF GHIJKLMNOPQRST &lt;/ExctgPty&gt; &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Prsn&gt; ... &lt;Othr&gt;  &lt;Id&gt;FR19620604JEA N#COCTE&lt;/Id&gt; &lt;SchmeNm&gt;  &lt;Prtry&gt;CONCAT&lt;/Prtry&gt;  &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/Prsn&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; </pre>

<pre> &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; ... &lt;FinInstrm&gt; ... &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt; ... &lt;/FinInstrm&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; ... &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt; ... &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; ... &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt; ... &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;Tx&gt; ... &lt;TradgCpcty&gt;DEAL&lt;/TradgCpcty&gt; ... &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; &gt; &lt;FullNm&gt;VODAFONE CFD&lt;/FullNm&gt; ... &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &gt; ... &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	---	---	--

Доклад #2 на инвестиционен посредник Y би включвал друга информация, свързана с референтните данни на инструмента, която не е посочена по-горе. За отчитане на извънборсови договори за разлика прочетете част IV от насоките.

### 5.30 Отчитане от място на търговия на сделка, изпълнена чрез неговите системи съгласно член 26, параграф 5 от Регламента за пазарите на финансови инструменти

Съгласно член 26, параграф 5 от Регламента за пазарите на финансови инструменти местата на търговия трябва да подадат отчети за сделки във връзка със сделки с финансови инструменти, търгувани на техните платформи, които се изпълняват чрез системите им от дружества извън обхвата на Регламента за пазарите на финансови инструменти.

Мястото на търговия трябва да попълни цялата информация, която дружеството щеше да отчита, ако попадеше в обхвата на Регламента за пазарите на финансови инструменти, както е посочено в таблица 2 на приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, включително обозначенията за инвестиционно решение в рамките на дружеството и изпълнението в рамките на дружеството, откази и флагове за показатели и обозначението за идентифициране на клиента, където е приложимо. Когато дружеството търгува за собствена сметка, тези данни следва да бъдат от гледна точка на дружеството. Когато дружеството търгува за клиент на база „за

собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или „всяко друго качество“ мястото на търговия следва да включва допълнителна информация в полета 8-15 (ако клиентът купува) или в полета 17- 24 (ако клиентът продава) и показателя за къса продажба за клиента и показателя за стоков дериват, където е относимо. Показателят за къса продажба и стоков дериват следва да бъде попълнен от гледна точка на клиента. По отношение на идентифицирането на изпълняващото дружество (поле 4) и на неговия клиент (поле 7 и поле 16), при което те отговарят на изискванията за LEI, изискванията съгласно член 5 и член 13, параграф 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията и член 26.6 на Регламента за пазарите на финансови инструменти са приложими. За клиенти, които не отговарят на изискванията за LEI код, мястото на търговия следва да провери, че предоставеният национален идентификационен номер не съдържа очевидни грешки или пропуски.

### 5.30.1 Дружеството търгува за собствена сметка

#### Пример 84

Дружество, което не е инвестиционен посредник, дружество С, купува финансови инструменти на място на търговия М за клиент. LEI на дружество С е 'RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR'. Операторът на мястото на търговия има LEI: 'TVTVTVTVTVTVTVTVTVT'. Мястото на търговия генерира идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC): '55555555' и референтен номер на сделка за отчета за сделка: '6868689'.

Как следва да отчита място на търговия М?

N	Поле	Стойности	XML представителство
2	Референтен номер на транзакция	'6868689'	<Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId>
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'55555555'	<ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVT</SubmitgPty>
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на дружество R	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
5	Инвестиционният посредник покрива Директива 2014/65/ЕС	'false'	<LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на оператора на място на търговия М	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI>
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на дружество R	</Id> </AcctOwnr> </Sellr>

16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	... <Tx>
29	Качеството, в което лицето търгува	'DEAL'	... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	... <TradVn>XMIC</TradVn>
			<TradPlcMtchglId>55555555</TradPlcMtchglId>
			</Tx>
			... </New>
			</Tx>

Полетата, които са свързани с инструмента, следва да бъдат попълнени, както е показано в част IV.

Ако съществува свързана извънборсова сделка с клиент от дружеството, тя не подлежи на отчитане от мястото на търговия, защото не е изпълнена през системите на мястото на търговия.

### 5.30.2 Дружество търгува на база „за собствена сметка, опосредено чрез насрещни сделки“ или „всяко друго качество“ за един клиент

#### Пример 85

Дружество, което не е инвестиционен посредник, дружество С, купува акции от регистъра с поръчки на място на търговия М за клиент, дружество Т, което също извършва действия за клиент, клиент У. LEI на дружество С е: 'RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR'. LEI на дружество S е 'SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS'. Операторът на мястото на търговия има LEI: 'TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV'. Мястото на търговия генерира идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC): '55555555' и референтен номер на сделка за отчета за сделка: '6868689'.

Когато дружество С извършва действия на база „всяко друго качество“ мястото на търговия се отчита както следва:

N	Поле	Стойност и	XML представителство
2	Референтен номер на транзакция	'6868689'	<Tx> <New>
3	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	'55555555'	... <TxId>6868689</TxId>
			<ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd>
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на дружество R	<SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty>
			... <Buyr>

5	Инвестиционен посредник, обхванат от Директива 2014/65/ЕС	'false'	<pre> &lt;AcctOwnr&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;SSSSSSSSSSSSSSSSSSSS&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;11111111111111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ...   &lt;TradgCpcty&gt;MTCH&lt;/TradgCpcty&gt; ...   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt;   &lt;TradPlcMtchgId&gt;55555555&lt;/TradPlcMtchgId&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на оператора на място на търговия М	
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на дружество S	
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	
29	Качеството, в което лицето търгува	'АОТС'	
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	

Полетата, които са свързани с инструмента, следва да бъдат попълнени, както е показано в част IV.

Ако дружество С търгува във „всяко друго свързано с търговия качество“, отчетът за сделка, подаден от мястото на търговия, трябва да идентифицира непосредствения основен клиент (дружество Т), а не клиент У.

Ако дружество С търгуваше на база „търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки“, отчитането би било идентично, с изключение че полето свързано с търговия качество следва да се попълни с 'MTCH'.

### 5.30.3 Дружеството събира поръчки за няколко клиента

Когато дружество обобщава поръчки за няколко клиента на място на търговия и извършва действия на база „всяко друго качество“ или „търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки“, мястото на търговия следва да отчита данните на всеки клиент. Това включва отчитане на допълнителна информация в полета 8-15 за купувач и еквивалентни полета за

продавач и показателят за къса продажба за клиента и показател за стоков дериват за клиента, където е приложимо.

#### Пример 86

Дружество, което не е инвестиционен посредник, дружество С, купува акции от регистъра с поръчки на място на търговия М за трима клиента, А, Б и В. Дружество С извършва действия на база „всяко друго качество“. Операторът на мястото на търговия има LEI: 'TVTVTVTVTVTVTVTVTV'. Мястото на търговия генерира идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC): '55555555' и референтен номер на сделка за отчета за пазарна сделка: '6868689' и за разпределения към клиенти: '6868690', '6868691' и '6868692'.

Как следва да отчита място на търговия М?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности #2 Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности #1 Инвестиционен Дружество Y	Доклад със стойности #2 Инвестиционен Дружество Y
2	Референтен номер на транзакция	'6868689'	'6868690'	'6868691'	'6868692'
3	Идентификационен код на място на търговия	'55555555'			
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на дружество R	{LEI} на дружество R	{LEI} на дружество R	{LEI} на дружество R
5	Инвестиционен посредник, обхванат от Директива 2014/65/ЕС	'false'	'false'	'false'	'false'
6	Идентификационен код на подаващия субект	{LEI} на оператора на място на търговия М	{LEI} на оператора на място на търговия М	{LEI} на оператора на място на търговия М	{LEI} на оператора на място на търговия М
7	Код за идентифициране на купувач	'INTC'	{LEI} на клиент А	{LEI} на клиент Б	{LEI} на клиент В
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент за място на търговия М	'INTC'	'INTC'	'INTC'
29	Качеството, в което лицето търгува	'АОТС'	'АОТС'	'АОТС'	'АОТС'



3 6	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия М	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
--------	---------------------	--------------------------------------	--------	--------	--------

XML представителство:

Доклад # 1 на Място на търговия М	Доклад # 2 на Място на търговия М	Доклад #3 на Място на търговия М	Доклад #4 на Място на търговия М
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;TxId&gt;6868689&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;RRRRRRR   RRRRRRRRRRRRRR&lt;/   ExctgPty&gt;    &lt;InvstmtPtyInd&gt;&gt;false&lt;/I   nvstmtPtyInd&gt;    &lt;SubmitgPty&gt;TVTDTV   TVTDTVTVTVTVTV   &lt;/SubmitgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Buyr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;11111111111111   111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...    &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/   TradgCpcty&gt;     ...   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradV   n&gt;    &lt;TradPlcMtchgId&gt;5555   5555&lt;/TradPlcMtchgI   d&gt;    &lt;/Tx&gt;   ... </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;TxId&gt;6868690&lt;/TxId&gt;    &lt;ExctgPty&gt;RRRRRRR   RRRRRRRRRRRRRR&lt;/   ExctgPty&gt;    &lt;InvstmtPtyInd&gt;&gt;false&lt;/I   nvstmtPtyInd&gt;    &lt;SubmitgPty&gt;TVTDTV   TVTDTVTVTVTVTV   &lt;/SubmitgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAA   AAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;Sellr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...    &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;/   TradgCpcty&gt;     ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Trad   Vn&gt;     &lt;/Tx&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;TxId&gt;6868691&lt;/TxId&gt;   &gt;    &lt;ExctgPty&gt;RRRRRRR   RRRRRRRRRRRRRR   R&lt;/ExctgPty&gt;    &lt;InvstmtPtyInd&gt;&gt;false   &lt;/InvstmtPtyInd&gt;    &lt;SubmitgPty&gt;TVTDT   VTDTVTVTVTVTVTV   &lt;/SubmitgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB   BBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;Sellr&gt;         &lt;AcctOwnr&gt;           &lt;Id&gt;    &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...    &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;   /TradgCpcty&gt;     ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Tra   dVn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt;&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;    &lt;TxId&gt;6868692&lt;/TxI   d&gt;    &lt;ExctgPty&gt;RRRRRRR   RRRRRRRRRRRRRR   R&lt;/ExctgPty&gt;    &lt;InvstmtPtyInd&gt;&gt;false   &lt;/InvstmtPtyInd&gt;    &lt;SubmitgPty&gt;TVTDT   VTDTVTVTVTVTVTV   &lt;/SubmitgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;    &lt;LEI&gt;CCCCCCCC   CCCCCCCCCC&lt;/L   EI&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;Sellr&gt;         &lt;AcctOwnr&gt;           &lt;Id&gt;    &lt;Intl&gt;INTC&lt;/Intl&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;     &lt;/Sellr&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...    &lt;TradgCpcty&gt;AOTC&lt;   /TradgCpcty&gt;     ...   &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/Tra   dVn&gt;     &lt;/Tx&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>



</Tx>
-------

## ЧАСТ IV – Отчитане на различни видове инструменти

### 5.32 Принципи

Когато дериватен инструмент е върху друг дериватен инструмент, например опция върху фючърс върху капиталов инструмент, ISIN кодът, който се попълва в полето код на основен инструмент (поле 47) на отчета за сделка е прекия основен инструмент т.е. фючърския договор в този пример, а не крайния основен инструмент (капиталов инструмент в този пример). Това не се прилага за дериват, допуснат до търговия или търгуван на място на търговия, тъй като единствено кодът за идентифициране на инструмент (поле 41) се прилага.

'NOAP' следва да се използва в полето цена, където цената не е приложима в дадена сделка (напр. подаръци). 'PNDG' се прилага, когато цената не е налична, а е изчакваща. Стойността '0' не следва да се използва като стойност по подразбиране.

Финансови инструменти, където основният инструмент е индекс, следва да бъдат отчитани. Това също обхваща случаите, когато индексът „се състои от финансови инструменти, търгувани на място на търговия“. В това отношение, следва да бъде отбелязано, че текстът „се състои от финансови инструменти, търгувани на място на търговия“ в член 26, параграф 2, буква в) от Регламента за пазарите на финансови инструменти следва да се разбира като отнасящ се до индекс и кошница.

### 5.33 Идентифициране на финансови инструменти, които са търгувани на място на търговия или присъстват в списък на ESMA

#### Пример 88

Инвестиционен посредник придобива финансов инструмент с ISIN код BE9999999999.

N	Поле	Стойности	XML представителство
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	<Tx> <New>
42	Пълно наименование на инструмента		.. <FinInstrm>
43	Класификация на инструмента		<Id>BE9999999999</Id> </FinInstrm>
44	Условна валута 1		...
45	Условна валута 2		</New>
46	Множител на цената		</Tx>
47	Код на базовия инструмент		
48	Наименование на базовия индекс		
49	Срок на базовия индекс		
50	Вид на опцията		
51	Цена на упражняване		
52	Валута на цената на упражняване		

53	Стил на упражняване на опция		
54	Дата на падеж		
55	Дата на изтичане		
56	Вид на доставката		

Единствено полето код за идентифициране на инструмент следва да бъде попълнено в този случай. Все пак, ако полетата свързани с референтните данни на инструмента също са осигурени, компетентните органи следва да не отхвърлят отчета за сделка.

### 5.34 Идентифициране на финансови инструменти, които не са търгувани на място на търговия или присъстват в списък на ESMA

#### 5.34.1 Финансови инструменти, търгувани на организирана платформа за търговия извън Съюза (място извън ЕИП)

##### Пример 89

Инвестиционен посредник търгува фючърсни договори за деривати (ISIN US0000000000) при 11.4653 долара за основен инструмент на организирана платформа за търговия извън Съюза. Основният инструмент (ISIN GB0000000000) се търгува на място на търговия.

Броят дялове от основната ценна книга, представена от един договор за дериват, е 1000.

CFI кодът за фючърсен договор е FFSCSX и договорът се заплаща в брой.

Сегментът MIC на мястото на търговия извън ЕИП е XUSA, а датата на изтичане на фючърския договор е 19 юни 2018 г.

N	Поле	Стойности	XML представителство
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на платформата за търговия U	<New> ... <Tx> ... <TradVn>XUSA</TradVn> ...
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN на фючърси}	</Tx> <FinInstrm>
42	Пълно наименование на инструмента	'ФЮЧЪРСЕН ДОГОВОР'	<Othr>
43	Класификация на инструмента	{CFI код}	<FinInstrmGnlAttrbts>
46	Множител на цената	'1000'	<Id>US0000000000</Id> <FullNm>FUTURE CONTRACT</FullNm>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовата ценна книга	<ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts>
55	Дата на изтичане	19.06.2018	<XpryDt>2018-06-19</XpryDt>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	<PricMltplr>1000</PricMltplr>

			<pre> &lt;UndrlygInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;Sngl&gt;       &lt;ISIN&gt;GB0000000000&lt;/ISIN&gt;     &lt;/Sngl&gt;   &lt;/Othr&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; </pre>
--	--	--	---

Ако ISIN съществува за финансов инструмент, търгуван на организирана платформа за търговия извън Съюза, то това следва да бъде посочено в поле 41. Полета 42 - 56 също ще трябва да бъдат попълнени, ако ISIN не е в списъка с референтни данни от ESMA.

### 5.34.2 Извънборсови деривати

#### Пример 90

Инвестиционен посредник търгува фючърсни договори за деривати извънборсово. Фючърсните договори за деривати нямат ISIN, все пак основният инструмент (ISIN GB0000000000) е допуснат до търговия или търгуван на място на търговия.

Броят дялове от основната ценна книга, представена от един договор за дериват, е 1000.

CFI кодът за фючърсен договор е FFSCSX и датата на изтичане на фючърския договор е 19 юни 2018 г. Договорът се предоставя в брой.

Полето множител на цената също се попълва с позоваване на прекия основен инструмент.

N	Поле	Стойности	XML представителство
36	Място на провеждане	'XXXX'	<pre> &lt;New&gt; ... &lt;Tx&gt;   &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; ... &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;       &lt;FullNm&gt;FUTURE CONTRACT JUN 2018&lt;/FullNm&gt;       &lt;ClssfctnTp&gt;FFSCSX&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt;   &lt;DerivInstrmAttrbts&gt;     &lt;XpryDt&gt;2018-6-19&lt;/XpryDt&gt;     &lt;PricMltplr&gt;1000&lt;/PricMltplr&gt;   &lt;UndrlygInstrm&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Sngl&gt; </pre>
41	Код за идентифициране на инструмента		
42	Пълно наименование на инструмента	'ФЮЧЪРСЕН ДОГОВОР ЮНИ 2018' ['FUTURE ONTRACT JUN 2018']	
43	Класификация на инструмента	{CFI код}	
46	Множител на цената	'1000'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия инструмент	
55	Дата на изтичане	19.06.2018	

56	Вид на доставката	‘Парични средства’	<pre> &lt;ISIN&gt;GB0000000000&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
----	-------------------	--------------------	---

Разликата между 5.34.1 и 5.34.2 е, че кодът за идентифициране на инструмент (поле 41) не се попълва в сценарий 5.34.2.

## 5.35 Отчитане на специфични финансови инструменти

### 5.35.1 Капиталови или сходни с капиталови инструменти

#### Пример 91

Инвестиционен посредник търгува 10 американски депозитарни разписки (ISIN: US0000000001) на американски пазар (MIC:XUSA). Основният инструмент (ISIN: GB0000000001) е допуснат до търговия или търгуван на място на търговия. CFI кодът е EDSXFB.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	‘10’	<Tx>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на платформа за търговия U	<New> ... <Tx> ...
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	<Qty> <Unit>10</Unit> </Qty>
43	Класификация на инструмента	{CFI код}	... <TradVn>XUSA</TradVn>
46	Множител на цената	‘1’	</Tx>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия инструмент	<FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000001</Id> <ClssfctnTp>EDSRFB</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts>

			</Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	---

## 5.35.2 Облигации или други форми на секюритизиран дълг

### 5.35.2.1 Сценарий, при който сделката е осъществена по чистата цена<sup>34</sup>

#### Пример 92

Инвестиционен посредник придобива облигация или секюритизиран дългов финансов инструмент EDF 2,25 % 2021 (ISIN код FR0011637586) като търгува извънборсово при 98. Номиналната сума на сделката е 1000000 EUR.

Нетната сума на сделката е 982650,68 EUR.

Като се има предвид това за целта на този пример:

**Постоянните характеристики (както са определени при издаване на финансовия инструмент) са:**

- Дата на падеж: 27.04.2021 г.
- Номинален купон: 2,25 %
- Честота на купонното плащане: годишно
- Конвенция за отчитане на дните: АСТ/АСТ (т.е., действителен брой изминали дни/действителен брой изминали дни)<sup>35</sup>
- Конвенция за деня на плащане: 2 работни дни след датата на търгуване

**Променливите (динамични характеристики в зависимост от пазарните условия) са:**

- Дата на търгуване: 5<sup>ти</sup> юни 2014
- Дата на сетълмента: 9<sup>ти</sup> юни 2014 г. (съгласно Конвенцията за деня на плащане)
- Дата на последното купоново плащане: 27<sup>ми</sup> април 2014 г.
- Дата на следващото купоново плащане: 27<sup>ми</sup> април 2015 г.

<sup>34</sup> Чиста цена = Мръсна цена – натрупана лихва

<sup>35</sup> АСТ/АСТ е препоръчаната конвенция за облигации на Международна асоциация на капиталовите пазари

- Натрупан брой дни 43 (т.е., броят дни между датата на последния купон и датата на сетълмента)
- База за периода: 365 (т.е., броят дни между датата на последния купон и датата на следващия купон)
- Количество: 1000000 (т.е., номинална или парична стойност на сделката)
- Чиста цена: 98
- Натрупана лихва 0,26506849 (т.е.  $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2.25}{1} \times \frac{43}{365}$ )

Nominal coupon	Номинален купон
Annual Coupon Frequency	Честота на годишния купон
Accrued Number of Days	Натрупан брой дни
Period Basis	База за периода

- Мръсната цена: 98.26506849 (т.е. чиста цена + натрупана лихва = 98 + 0,26506849)

Нетната сума ще бъде изчислена както следва (съгласно формулата, предвидена в поле 35 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията):

Нетна сума = (чиста цена x номинална стойност) + (начислени купони x номинална стойност) т.е.  
 $(\frac{98}{100} \times 1000000 \text{ EUR}) + (\frac{0.26506849}{100} \times 1000000) = 982650,68 \text{ EUR}$

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'1000000'	<Tx>
31	Валута на количеството	'EUR'	<New>
33	Цена	'98'	...
35	Нетна сума	'982650.68'	<Tx>
36	Място на провеждане	'XOFF'	...
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	<Qty>
			<NmnlVal
			Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Pctg>98</Pctg>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>982650.68</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Id>FR0011637586</Id>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>



### 5.35.2.2 Сценарий, при който цената на финансовия инструмент е по отношение на проста дисконтова доходност

#### Пример 93

Инвестиционен посредник придобива холандски финансов сертификат (краткосрочна облигация) DTB 0 % 12/30/16 (ISIN код NL0011923107) като търгува при -0,609 %. Номиналната стойност на сделката е 1000000 EUR.

Нетната сума на сделката е 1002611,97 EUR.

Като се има предвид това за целта на този пример:

**Постоянните характеристики (както са определени при издаване на финансовия инструмент) са:**

- Дата на падеж: 30<sup>ти</sup> декември 2016 г.
- Конвенция за отчитане на дните: Реален брой изминали дни/360
- Конвенция за деня на плащане: 2 работни дни след датата на търгуване

**Променливите (динамични характеристики в зависимост от пазарните условия) са:**

- Дата на търгуване: 27<sup>ми</sup> юли 2016 г.
- Дата на сетълмента: 29<sup>ми</sup> юли 2016 г.
- Дни до падежа: 154 (т.е. броят дни от датата на сетълмент до датата на падежа)
- База за периода: 360 (т.е. общ брой дни по конвенция)
- Количество: 1000000 (т.е. номинална или парична стойност на сделката)
- Дисконтирана доходност на краткосрочната облигация: -0,609 %
- Чиста цена: 100.261197 (т.е.  $\frac{100}{1 + \frac{Yield \cdot Days\ until\ maturity}{100 \cdot Period\ Basis}} = \frac{100}{1 + \frac{-0.609 \cdot 154}{100 \cdot 360}}$ )

Yield	Доходност
Days until maturity	Дни до падежа
Perior Basis	База за пеиода

- Мръсната цена: 100,261197 (т.е. чиста цена + натрупана лихва = 100,261197 + 0)

Нетната сума ще бъде изчислена както следва (съгласно формулата, предвидена в поле 35 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията):

Нетна сума = (чиста цена x номинална стойност) + (начислени купони x номинална стойност) т.е.  
 $\left(\frac{100.261197}{100} \times 1000000 \text{ EUR}\right) + (0 \times 1000000 \text{ EUR}) = 1002611,97 \text{ EUR}$

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'1000000'	<Tx>
31	Валута на количеството	'EUR'	<New>
33	Цена	'-0.609'	... <Tx>
34	Валута на цената		...
35	Нетна сума	1002611.97	<Qty>
36	Място на провеждане	'XOFF'	<NmnlVal
41	Код за идентифициране на инструмента	{ISIN} на инструмента	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Yld>-0.609</Yld> </Pric> </Pric> <NetAmt>1002611.97</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>NL0011923107</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.2.3 Сценарий, при който цената на финансовия инструмент (нулев купон) е по отношение на доходността на дългосрочна облигация

#### Пример 94

Инвестиционен посредник придобива Strip FRTR 0 % 04/25/2041 (ISIN код FR0010773200) като търгува извънборсово при 1,06 %. Номиналната стойност на сделката е 1000000 EUR.

Нетната сума на сделката е 770343,52 EUR.

Като се има предвид това за целта на този пример:

**Постоянните характеристики (както са определени при издаване на финансовия инструмент) са:**

- Дата на падеж: 25 април 2041 г.
- Честота на купонното плащане: липсва
- Конвенция за отчитане на дните: АСТ/АСТ
- Конвенция за деня на плащане: 2 работни дни след датата на търгуване

**Променливите (динамични характеристики в зависимост от пазарните условия) са:**

- Дата на търгуване: 25 юли 2016 г.

- Дата на сетълмента: 27 юли 2016 г.
- База за периода: 365
- Време до падеж (от датата на плащане 27<sup>ми</sup> юли 2016 г. до датата на падеж 25<sup>ти</sup> април 2041 г.): „(24+272/365) години“
- Количество: 1000000 (т.е. номинална или парична стойност на сделката)
- Доходност на облигацията на инструмента „Strip“: 1,06 %
- Чиста цена: 77.0343516 (т.е.  $\frac{100}{(1+\frac{Yield}{100})^{Time\ to\ maturity}} = \frac{100}{(1+\frac{1.06}{100})^{(24+\frac{272}{365})}}$ )

Yield	Доходност
Time to maturity	Срок до падежа

- Мръсната цена: 77,0343516 (т.е. чиста цена + натрупана лихва = 77,0343516 + 0)

Нетната сума ще бъде изчислена както следва (съгласно формулата, предвидена в поле 35 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията):

Нетна сума = (чиста цена x номинална стойност) + (начислени купони x номинална стойност) т.е.  
 $(\frac{77.0343516}{100} \times 1000000 \text{ EUR}) + (0 \times 1000000 \text{ EUR}) = 770343,52 \text{ EUR}$

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'1000000'	<Tx>
31	Валута на количеството	'EUR'	<New>
33	Цена	'1.06'	...
34	Валута на цената		<Tx>
35	Нетна сума	770343.52	...
36	Място на провеждане	'XOFF'	<Qty>
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	<NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Yld>1.06</Yld>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>770343.52</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Id>FR0010773200</Id>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

#### 5.35.2.4 Конвертируема облигация

5.35.2.4.1 *Сценарий, при който цената на конвертируемата дългосрочна облигация, е по чиста цена:*

##### Пример 95

Инвестиционен посредник придобива Vodafone 2 % 02/25/2019 (ISIN код XS1371473601) като търгува извънборсово при 114,00. Номиналната стойност на сделката е 1000000 GBP.

Нетната сума на сделката е 1148406,59 GBP.

Като се има предвид това за целта на този пример:

**Постоянните характеристики (както са определени при издаване на финансовия инструмент) са:**

- Дата на падеж: 25 февруари 2019 г.
- Номинален купон: 2 %
- Честота на купонното плащане: веднъж на шест месеца
- Конвенция за отчитане на дните: ICMA реален брой изминали дни/реален брой изминали дни
- Конвенция за деня на плащане: 2 работни дни след датата на търгуване

**Променливите (динамични характеристики в зависимост от пазарните условия) са:**

- Дата на търгуване: 25 юли 2016 г.
- Дата на сетълмента: 27 юли 2016 г.
- Дата на последното купоново плащане: 25 февруари 2016 г.
- Дата на следващото купоново плащане: 25 август 2017 г.
- Натрупан брой дни 153 (т.е. броят дни между датата на последния купон и датата на сетълмента)
- База за периода: 182 (т.е. броят дни между датата на последния купон и датата на следващия купон)
- Количество: 1000000 (т.е. номинална или парична стойност на сделката)
- Чиста цена: 114,00
- Натрупана лихва 0.84065934 (т.е.  $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2}{2} \times \frac{153}{182}$ )

Nominal Coupon	Номинален купон
Annual Coupon Frequency	Честота на годишния купон
Accrued Number of Days	Натрупан брой дни
Period Basis	База за периода

- Мръсната цена: 114. 8406593 (т.е. чиста цена + натрупана лихва = 114,00 + 0,84065934)

Нетната сума ще бъде изчислена както следва (съгласно формулата, предвидена в поле 35 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията):

Нетна сума = (чиста цена x номинална стойност) + (начислени купони x номинална стойност) т.е.  
 $(\frac{114}{100} \times 1000000 \text{ GBP}) + (\frac{0.84065934}{100} \times 1000000 \text{ GBP}) = 1148406,59 \text{ GBP}$

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'1000000'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Qty&gt;         &lt;NmnlVal Ccy="GBP"&gt;1000000&lt;/NmnlVal&gt;         &lt;/Qty&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;Pctg&gt;114.00&lt;/Pctg&gt;         &lt;/Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;NetAmt&gt;1148406.59&lt;/NetAmt&gt;         &lt;/Pric&gt;         &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;       &lt;/Tx&gt;       &lt;FinInstrm&gt;         &lt;Id&gt;XS1371473601&lt;/Id&gt;       &lt;/FinInstrm&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Tx&gt; </pre>
31	Валута на количеството	'GBP'	
33	Цена	'114.00'	
35	Нетна сума	'1148406.59'	
36	Място на провеждане	'XOFF'	
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	

#### 5.35.2.4.2 Сценарий, при който цената на финансовия инструмент е в търгуваната валута

##### Пример 96

Инвестиционен посредник придобива 10,000 конвертируеми дългосрочни облигации CapGemini 0 % 01/01/19 (ISIN код FR0011600352) като търгува извънборсово при 80 EUR. Нетната сума за тази сделка е 800000 EUR= 10000 x 80 EUR.

Като се има предвид това за целта на този пример:

Постоянните характеристики (както са определени при издаване на финансовия инструмент) не са значими за отчитането на сделката.

Променливите (динамични характеристики в зависимост от пазарните условия) са:

- Количество: 10000 (т.е. броят единици от финансовия инструмент)
- Цената на финансовия инструмент във валутата на сделката: 80 EUR

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'10000'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;10000&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;80&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       &lt;NetAmt&gt;800000&lt;/NetAmt&gt;       &lt;TradVn&gt;XOFF&lt;/TradVn&gt;     &lt;/Tx&gt;     &lt;FinInstrm&gt;       &lt;Id&gt;FR0011600352&lt;/Id&gt;     &lt;/FinInstrm&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
31	Валута на количеството		
33	Цена	'80'	
34	Валута на цената	'EUR'	
35	Нетна сума	'800000'	
36	Място на провеждане	'XOFF'	
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на инструмента	

### 5.35.3 Опции

#### 5.35.3.1.1 Капиталова опция

##### Пример 97

Инвестиционен посредник купува 10 капиталови кол опции при 11,46 EUR на договор от друг инвестиционен посредник. Кол опция не се търгува на място на търговия, но основният капиталов инструмент се търгува там.

Множителят на цената (броят основни капиталови инструменти, представени в един договор) е 5, цената на упражняване (цената, при която основният инструмент е закупен или продаден, когато опция е упражнена) е 70 EUR. ISIN на капиталовия инструмент е DE0000000001. CFI кодът е HESAVP.

Договорът за опция изтича на 31 декември 2018 г. и се урежда физически.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'10'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt; </pre>
33	Цена	'11.46'	

34	Валута на цената	'EUR'	...
51	Място на провеждане	'XXXX'	<Tx>
41	Код за идентифициране на инструмент		...
42	Пълно наименование на инструмента	'КАПИТАЛО ВА КОЛ ОПЦИЯ'	<Qty> <Unit>10</Unit> </Qty>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">11.46</Amt> </MntryVal>
46	Множител на цената	'5'	</Pric>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на основния капиталов инструмент	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>
50	Вид на опцията	'КОЛ'	...
51	Цена на упражняване	'70'	</Tx>
52	Валута на цената на упражняване	'EUR'	<FinInstrm>
53	Стил на упражняване на опция	'EURO'	<Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>EQUITY CALL OPTION</FullNm>
55	Дата на изтичане	31.12.2018	<ClssfctnTp>OCESPS</ClssfctnTp>
56	Вид на доставката	'PHYS'	</FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>5</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">70</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>PHYS</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

### 5.35.3.1.2 Извънборсов индекс на базата на договор за опция

#### Пример 98

Инвестиционен посредник продава 50 FTSE 100 Index Bespoke договори за кол опция извънборсово при 2 GBP на договор.

Основният индекс е FTSE 100 (ISIN: GB0001383545).

Датата на изтичане е 14 август 2018 г. Цената на упражняване е 3500, а множителят на цената е 25. Опцията е европейски тип и се заплаща в брой.

CFI кодът за договор за опция е: HEIAVC.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'50'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;Tx&gt;       ...       &lt;Qty&gt;         &lt;Unit&gt;50&lt;/Unit&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pric&gt;           &lt;MntryVal&gt;             &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;2&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/Pric&gt;       &lt;/Pric&gt;       &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;         &lt;FullNm&gt;FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION&lt;/FullNm&gt;         &lt;ClssfctnTp&gt;OCEICN&lt;/ClssfctnTp&gt;       &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt;       &lt;DerivInstrmAttrbts&gt;         &lt;XpryDt&gt;2018-08-14&lt;/XpryDt&gt;         &lt;PricMltplr&gt;25&lt;/PricMltplr&gt;       &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt;       &lt;UndrlygInstrm&gt;         &lt;Othr&gt;           &lt;Sngl&gt;             &lt;ISIN&gt;GB0001383545&lt;/ISIN&gt;             &lt;Indx&gt;               &lt;Nm&gt;                 &lt;RefRate&gt;                   &lt;Nm&gt;FTSE100&lt;/Nm&gt;                 &lt;/RefRate&gt;               &lt;/Nm&gt;             &lt;/Indx&gt;           &lt;/Sngl&gt;         &lt;/Othr&gt;       &lt;/UndrlygInstrm&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/FinInstrm&gt; </pre>
33	Цена	'2'	
34	Валута на цената	'GBP'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	
41	Код за идентифициране на инструмент		
42	Пълно наименование на инструмента	'FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION'	
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
46	Множител на цената	'25'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия индекс	
48	Наименование на базовия индекс	{Име на индекса, което да бъде вмъкнато}	
50	Вид на опцията	'КОЛ'	
51	Цена на упражняване	'3500'	
53	Стил на упражняване на опция	'EURO'	
55	Дата на изтичане	14.08.2018	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	



			<pre> &lt;/Othr&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;OptnTp&gt;CALL&lt;/OptnTp&gt; &lt;StrkPric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;BsisPts&gt;3500&lt;/BsisPts&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/StrkPric&gt; &lt;OptnExrcStyle&gt;EURO&lt;/OptnExrcStyle&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	---

### 5.35.4 Договори за разлики

#### Пример 99

Инвестиционен посредник X търгува договор за разлика (ДР). Основен капиталов инструмент Vodafone е допуснат до търговия на регулиран пазар, но договорът за разлика не се търгува на място на търговия.

Брой търгувани договори за разлика 10000. Цената на договора за разлика е 3,374 EUR. ISIN кодът на основния капиталов инструмент (Vodafone) е GB00BH4HKS39.

CFI кодът за договор за разлика е: JESXCC. Множителят на цената е 1 като отразява факта, че един договор за разлика представлява един дял от основния инструмент.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'10000'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;Qty&gt;       &lt;Unit&gt;10000&lt;/Unit&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;3.374&lt;/Amt&gt;         &lt;/MntryVal&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt;     ...   &lt;/Tx&gt; &lt;/FinInstrm&gt; &lt;Othr&gt;   &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;     &lt;FullNm&gt;VODAFONE CFD&lt;/FullNm&gt;     &lt;ClssfctnTp&gt;JESXCC&lt;/ClssfctnTp&gt; </pre>
33	Цена	'3.374'	
34	Валута на цената	'EUR'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	
41	Код за идентифициране на инструмент		
42	Пълно наименование на инструмента	'VODAFONE CFD'	
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
46	Множител на цената	'1'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия собствен капитал	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

			<pre> &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt;   &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt;   &lt;UndrlygInstrm&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;Sngl&gt;         &lt;ISIN&gt;GB00BH4HKS39&lt;/ISIN&gt;       &lt;/Sngl&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/UndrlygInstrm&gt;   &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

### 5.35.5 Финансово залагане

#### 5.35.5.1 Обвързано с възвращаемостта на акции финансово залагане

##### Пример 100

Инвеститор търгува подновяващо се всеки ден финансово залагане върху капиталов инструмент. Финансовото залагане не се търгува на място на търговия, но основният капиталов инструмент се търгува там.

Заложената сума е 0.5 GBP за движение в цената в по-малката единица на валутата.

Референтната цена на основния финансов инструмент(ABC PLC) е 102,23 EUR.

Пълното име на инструмента е поле за свободен текст, което се попълва от изпълняващия субект: ABC BET SEP 15 SPREAD. CFI кодът за финансово залагане върху капиталов инструмент е JESXSC.

Множителят на цената е движението за точка в цената на основния инструмент: 100. т.е. 100 цента до 1 EUR. Следователно, за всеки цент движение печалбата или загубата на инвеститорите се коригира с 0,50 GBP.

ISIN кодът на основния капиталов инструмент е GB0000000004.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'0.50'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;Qty&gt;       &lt;MntryVal Ccy="GBP"&gt;0.50&lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Qty&gt; </pre>
31	Валута на количеството	'GBP'	
33	Цена	'102.23'	
34	Валута на цената	'EUR'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	

41	Код за идентифициране на инструмент		<pre> &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;102.23&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;       &lt;FullNm&gt;ABC BET SPREAD&lt;/FullNm&gt;       &lt;ClssfctnTp&gt;JESXSC&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt;     &lt;DerivInstrmAttrbts&gt;       &lt;PricMltplr&gt;100&lt;/PricMltplr&gt;       &lt;UndrlygInstrm&gt;         &lt;Othr&gt;           &lt;Sngl&gt;             &lt;ISIN&gt;GB0000000004&lt;/ISIN&gt;           &lt;/Sngl&gt;         &lt;/Othr&gt;       &lt;/UndrlygInstrm&gt;       &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt;     &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt;   &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
42	Пълно наименование на инструмента	'ABC BET SPREAD'	
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
46	Множител на цената	'100'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия собствен капитал	
55	Дата на изтичане		
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

За подновяващи се ежедневно финансови залагания, единствено сделката за първоначално откриване и сделката за окончателно закриване на договора трябва да бъдат отчетени. Датата на изтичане не е попълнена.

#### 5.35.5.2 Финансово залагане за фючърс върху облигация

##### Пример 101

ISIN кодът, попълнен в полето на кода на основния инструмент (поле 47) на отчета за сделка следва да бъде прекия основен финансов инструмент. В този пример това е идентификатора за фючърсен договор за облигация, а не за крайния основен финансов инструмент (т.е. облигацията).

Инвеститор търгува подновяващо се ежедневно финансово залагане върху фючърс върху облигация, където фючърсът върху облигация се търгува на място на търговия.

Заложената сума при финансовото залагане е 2 GBP на точка. Референтната цена (в базисни точки) на основния финансов инструмент е 9100.

Пълното име на инструмента е поле за свободен текст, което се попълва от изпълняващия субект: Bond Future BET 27MAY15.

CFI кодът за финансово залагане върху фючърс върху облигация е JCAXSC.

Множителят на цената е движението за точка в цената за основен инструмент: 1. ISIN кодът за основния фючърс върху облигация е GB1234567891.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'2'	<Tx>
31	Валута на количеството	'GBP'	<New>
33	Цена	'9100'	...
36	Място на провеждане	'XXXX'	<Tx>
41	Код за идентифициране на инструмент		...
42	Пълно наименование на инструмента	'BOND FUTURE BET 27MAY15'	<Qty>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal>
46	Множител на цената	'1'	</Qty>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия фючърс	<Pric>
55	Дата на изтичане		<Pric>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	<BsisPts>9100</BsisPts>
			</Pric>
			<TradVn>XXXX</TradVn>
			...
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>BOND FUTURE BET
			27MAY15</FullNm>
			<ClssfctnTp>JCAXSC</ClssfctnTp>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Othr>
			<Sngl>
			<ISIN>GB1234567891</ISIN>
			</Sngl>
			</Othr>
			</UndrlygInstrm>
			<DlvryTp>CASH</DlvryTp>
			</DerivInstrmAttrbts>
			</Othr>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

### 5.35.5.3 Финансово залагане върху индекс

#### Пример 102

Инвеститор търгува финансово залагане върху капиталов индекс, който се състои от поне един финансов инструмент, допуснат до търговия на място на търговия. Финансовото залагане не се търгува на място на търговия.

Заложената сума при финансовото залагане е 10 GBP за движение в точката на индекса, а референтната цена на основния финансов инструмент е 9340.

Пълното име на инструмента е поле за свободен текст, което се попълва от изпълняващия субект: FTSE Index BET.

CFI кодът за финансово залагане върху капиталов индекс е JCAXSC.

Позицията на финансовото залагане изтича в ден T+1, където T е 27.10.2018 г.

Множителят на цената е движението за точка на индекса, т.е. 1. За всяко движение на точка на индекса, печалбата или загубата на инвеститорите се коригира с 10 GBP.

ISIN кодът на индекса е GB0001383545.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'10'	<Tx>
31	Валута на количеството	'GBP'	<New>
33	Цена	'9340'	...
36	Място на провеждане	'XXXX'	<Tx>
41	Код за идентифициране на инструмента		...
42	Пълно наименование на инструмента	'FTSE INDEX BET'	<Qty>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal>
46	Множител на цената	'1'	</Qty>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия индекс	<Pric>
48	Наименование на базовия индекс	'FTSE100'	<Pric>
55	Дата на изтичане	28.10.2018	<BsisPts>9340</BsisPts>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	</Pric>
			<TradVn>XXXX</TradVn>
			...
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>FTSE INDEX BET</FullNm>
			<ClssfctnTp>JEIXSC</ClssfctnTp>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<XpryDt>2018-10-28</XpryDt>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Othr>
			<Sngl>
			<Indx>
			<ISIN>GB0001383545</ISIN>

			<pre> &lt;Nm&gt;   &lt;RefRate&gt;     &lt;Nm&gt;FTSE100&lt;/Nm&gt;   &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/UndrlyInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	---

#### 5.35.5.4 Финансово залагане върху извънборсово търгувано валутно форуърдно лихвено споразумение (FRA)

##### Пример 103

Инвеститор изпълнява залог върху едногодишно GBP/USD форуърдно лихвено споразумение (GBP/USD FRA JUN16). Финансовото залагане не се търгува на място на търговия.

Валутната двойка GBP/USD FRA JUN16 се търгува при 1.5355 (обменен курс).

Заложената сума е 5 GBP за движение в по-малката единица на валутата. Множителят на цената е движението за точка в по-малката валута на референтната цена на основния инструмент: 100.

ISIN на GBP/USD FRA JUN16 е GB0000000006.

CFI кодът за финансово залагане върху GBP/USD FRA е JFRXSC.

Датата на изтичане на FRA е 30 юни 2016 г. и това е датата на изтичане на финансовото залагане.

Финансовото залагане се заплаща в брой.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'5'	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;/Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;MntryVal Ccy="GBP"&gt;5&lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt; </pre>
31	Валута на количеството	'GBP'	
33	Цена	'1.5355'	
34	Валута на цената	'GBP'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	
41	Код за идентифициране на инструмент		

42	Пълно наименование на инструмента	'GBP/USD FRA JUN16 BET'	<pre> &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;1.5355&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; ... &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;Othr&gt; &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;FullNm&gt;GBP/USD FRA JUN16 BET&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;JFRXSC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2016-06-30&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;100&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Othr&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;ISIN&gt;GB0000000006&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
46	Множител на цената	'100'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на основния FRA	
55	Дата на изтичане	30.06.2016	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

#### 5.35.5.5 Финансово залагане върху извънборсово търгувана лихвена опция

##### Пример 104

Инвеститор прави залог от 2 GBP на базисна точка върху 6-месечна GBP LIBOR опция.

6-месечна GBP LIBOR опция се търгува при 0,71375 процента на Т. ISIN на 6-месечната GBP LIBOR опция е GB0000000007.

CFI кодът за финансово залагане върху опция върху LIBOR в британски лири е JRMXSC.

Датата на изтичане на GBP LIBOR опцията е 17 декември 2018 г. и това е датата на изтичане на финансовото залагане.

Множителят на цената е 10000 като 1 базисна точка е 0,01 %. Печалбата или загубата на инвеститора се коригира с 2 GBP за всяко 0,01 процентно движение в референтната цена.

N	Поле	Стойности	XML представителство
30	Количество	'2'	<Tx>
31	Валута на количеството	'GBP'	<New> ...

33	Цена	'0.71375'	<pre> &lt;Tx&gt; ... &lt;Qty&gt;   &lt;MntryVal Ccy="GBP"&gt;2&lt;/MntryVal&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pctg&gt;0.71375&lt;/Pctg&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;       &lt;FullNm&gt;OPTION GBP LIBOR DEC15 BET&lt;/FullNm&gt;       &lt;ClssfctnTp&gt;JRMXSC&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt;     &lt;DerivInstrmAttrbts&gt;       &lt;XpryDt&gt;2018-12-17&lt;/XpryDt&gt;       &lt;PricMltplr&gt;10000&lt;/PricMltplr&gt;       &lt;UndrlygInstrm&gt;         &lt;Othr&gt;           &lt;Sngl&gt;             &lt;ISIN&gt;GB0000000007&lt;/ISIN&gt;           &lt;/Sngl&gt;         &lt;/Othr&gt;       &lt;/UndrlygInstrm&gt;       &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt;     &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
36	Място на провеждане	'XXXX'	
41	Код за идентифициране на инструмент		
42	Пълно наименование на инструмента	'OPTION GBP LIBOR DEC15 BET'	
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
46	Множител на цената	'10000'	
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовата опция	
55	Дата на изтичане	17.12.2018	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

Основният инструмент, идентифициран в отчета за сделка, е договора за лихвена опция.

### 5.35.6 Суап за кредитно неизпълнение

#### Пример 105

Инвестиционен посредник X купува извънборсов суап за кредитно неизпълнение (СКН) върху Allianz SE на стойност 1000000 EUR (един милион евро) срещу купон от 100 базисни точки от инвестиционен посредник Y. СКН се заплаща в брой.

Суапът за кредитно неизпълнение изтича на 30 юли 2020 г.

Инвестиционен посредник X получава авансово плащане от инвестиционен посредник Y в размер на 33879 EUR.



ISIN на основната облигация е: ZA2344558978 и се търгува на място на търговия. CFI за суап за кредитно неизпълнение е SCUCCC.

Отчетът за сделка по-долу е от гледна точка единствено на инвестиционен посредник X.

N	Поле	Стойности	XML представителство
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
30	Количество	'1000000'	</Buyr>
31	Валута на количеството	'EUR'	<Sellr>
33	Цена	'100'	<AcctOwnr>
36	Място на провеждане	'XXXX'	<Id>
38	Авансово плащане	'-33879'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI>
39	Валута на авансовото плащане	'EUR'	</Id> </AcctOwnr>
41	Код за идентифициране на инструмент		</Sellr> <Tx>
42	Пълно наименование на инструмента	'ALLIANZ SE SNR CDS'	<Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	</Qty> <Pric>
46	Множител на цената	'1'	<Pric> <BsisPts>100</BsisPts>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовата облигация	</Pric> </Pric>
55	Дата на изтичане	20.06.2021	<TradVn>XXXX</TradVn>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	<UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">33879</Amt> <Sgn>>false</Sgn> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ALLIANZ SE SNR CDS</FullNm> <ClssfctnTp>SCUCCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2021-06-20</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>ZA2344558978</ISIN> </Sngl> </Othr>

			<pre> &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt;  .. &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	---

Ако не съществува авансово плащане, поле 38 следва да се попълни с '0'.

Ако инвестиционен посредник X получава авансово плащане, а не извършва авансово плащане, стойността на авансовото плащане, посочена в поле 38, е отрицателна.

### 5.35.7 Суапове

Когато са налице отделни парични потоци, участващи в сделката и посоката не може да бъде определена с позоваване на полето купувач /продавач, това ще бъде посочено чрез използването на знак '+' или '-' пред кода на основния инструмент или името на основния индекс, както е уместно. Знак '+' посочва, че купувачът получава (резултатите от) основния инструмент, а знак '-' посочва, че купувачът заплаща (резултатите от) основния инструмент. Знаците '+' и '-' са включени в таблиците в примерите, за да илюстрират каква е посоката на суапа, все пак тези символи ще се появят в XML схемата като XML тагове, които придружават съответната отчетна стойност (напр. кода на основния инструмент). Знаците '+' или '-' са представени като 'SwpIn' или 'SwpOut' в XML текста.

Инвестиционните посредници се очаква да използват знаците '-' и '+' точно и последователно. В случая купувачът или продавачът на договор за суап не може да бъде извлечен от описанието в съответните полета на Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, напр. капиталов суап с два капиталови „крака“, знаците „+“ и „-“ в поле 47 и/или 48 следва адекватно да отразяват какво дружеството, идентифицирано като купувача в отчета за сделка, получава и какво дружеството, идентифицирано като продавача в отчета за сделка, заплаща.

Авансовото плащане може да се прилага за всеки договор за суап.

#### 5.35.7.1 Капиталов суап (един „крак“ на собствения капитал)

##### Пример 106

Инвестиционен посредник X търгува извънборсово OTC капиталов суап с инвестиционен посредник Y. Основният капиталов инструмент е допуснат до търговия на място на търговия. Дружество X получава риска, свързан с движението на цената на основния капиталов инструмент и заплаща LIBOR3M плюс премия от 0,05 %.

Условната стойност на договора за суап е 1000000 EUR, а референтната цена на основната акция е 50 USD. Договорът за суап изтича на 31 декември 2018 г. и се заплаща в брой.

Пълното име на инструмента е BAYER EQS LIBOR3M+ 0,05 %. CFI кодът за капиталов суап е SESPXC.

Основният капиталов инструмент е Bayer AG NA (ISIN DE000BAY0017)

Основният лихвен процент е LIBOR3M при 3,7 % + 0,05 % със срок 3 месеца.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Стойност и	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
30	Количество	'1000000'	</Buyr>
31	Валута на количеството	'EUR'	<Sellr> <AcctOwnr>
33	Цена	'0.05'	<Id>
34	Валута на цената		
36	Място на провеждане	'XXXX'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
41	Код за идентифициране на инструмент		</Id> </AcctOwnr> </Sellr>
42	Пълно наименование на инструмента	'BAYER EQS LIBOR3M+0.05 % SEP 15'	... <Tx> ...
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
44	Условна валута 1	'EUR'	</Qty>
46	Множител на цената	'1'	<Pric>
47	Код на базовия инструмент	'+'DE000BAY0017'	<Pric> <Pctg>0.05</Pctg>
48	Наименование на базовия индекс	'-'LIBO'	</Pric>
49	Срок на базовия индекс	'3'MNTH'	<TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
55	Дата на изтичане	31.12.2018	<FinInstrm>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	<Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp>

			<pre> &lt;SwpIn&gt;   &lt;Sngl&gt;     &lt;ISIN&gt;DE000BAY0017&lt;/ISIN&gt;   &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpIn&gt; &lt;SwpOut&gt;   &lt;Sngl&gt;     &lt;Indx&gt;       &lt;Nm&gt;         &lt;RefRate&gt;           &lt;Indx&gt;LIBO&lt;/Indx&gt;         &lt;/RefRate&gt;         &lt;Term&gt;           &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt;           &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt;         &lt;/Term&gt;       &lt;/Nm&gt;     &lt;/Indx&gt;   &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

Обърнете внимание, че поле 30 Количество следва да съдържа номиналната стойност на отчетената сделка за договор за суап. Поле 46 Множител на цената следва да съдържа броя на договорите за суап, търгувани в сделката. Поле 33 Цена следва да съдържа платения/получения спред освен основния лихвен процент, където е приложимо.

Знакът „+“ преди кода на основния инструмент посочва, че купувачът получава изпълнението на BAYER AG NA.

Знакът „-“ преди името на основния индекс посочва, че купувачът заплаща лихвения процент.

5.35.7.2 Капиталов суап (два „крака“ на собствения капитал), търгуван на платформа за търговия извън Съюза (инструментът не е наличен в списъка на ESMA)

#### Пример 107

Инвестиционен посредник X купува капиталов суап на платформа за търговия извън Съюза и следователно суапът не е наличен в списъка на ESMA. Основните капиталови индекси съдържат финансови инструменти, които са допуснати до търговия на регулиран пазар.

Платформата за търговия използва централен контрагент с LEI: CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

ISIN на договора за суап е US000DAX000X, а условната сума съгласно договора за суап е 1000000 EUR.

Договорът изтича на 25 юни 2016 г. и се заплаща в брой.

Един от основните индекси е DAX 30 Index (ISIN DE0008469008)

Друг основен индекс е IBEX 35 Index (ISIN ES0SI0000005)

Договорът за суап има спред '0' и двата инвестиционни посредника са съгласни дружество X да заплати на дружество Y сумата в размер на 1000 EUR авансово.

Кодът на мястото за капиталов суап е XUSA, а мястото използва централен контрагент с LEI: CCPCCPCC.

Пълното име на инструмента е поле за свободен текст, което се попълва от изпълняващия субект: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16

CFI кодът за капиталов суап е SEIPXC.

Инвестиционен посредник X получава резултатите за DAX и заплаща резултатите за IBEX.

Как трябва да се отчитат инвестиционни посредници X и Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на централен контрагент
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на централен контрагент	{LEI} на инвестиционен посредник Y
30	Количество	1000000	1000000
31	Валута на количеството	'EUR'	'EUR'
33	Цена	'0'	'0'
34	Валута на цената		
36	Място на провеждане	'XUSA'	'XUSA'
38	Авансово плащане	'1000'	'1000'
39	Валута на авансовото плащане	'EUR'	'EUR'
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN}	{ISIN}
42	Пълно наименование на инструмента	'DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'	'DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'
43	Класификация на инструмента	'SEIPXC'	'SEIPXC'
44	Условна валута 1	'EUR'	'EUR'

46	Множител на цената	'1'	'1'
47	Код на базовия инструмент	'+'{DAX 30 ISIN} '-'{IBEX 35 ISIN}	'+'{DAX 30 ISIN} '-'{IBEX 35 ISIN}
48	Наименование на базовия индекс	'+'DAX 30' '-'IBEX 35'	'+'DAX 30' '-'IBEX 35'
55	Дата на изтичане	25.06.2016	25.06.2016
56	Вид на доставката	'Парични средства'	'Парични средства'

XML представителство:

Доклад от инвестиционен посредник X	Доклад от инвестиционен посредник Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;Qty&gt;       &lt;NmnlVal&gt;         Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/NmnlVal&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XUSA&lt;/TradVn&gt;     &lt;UpFrntPmt&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000&lt;/Amt&gt;     &lt;/UpFrntPmt&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;     &lt;Othr&gt;       &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt;         &lt;Id&gt;US000DAX000X&lt;/Id&gt;       &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt;     &lt;/Othr&gt;   &lt;/FinInstrm&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/E xctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ...   &lt;Tx&gt;     ...     &lt;Qty&gt;       &lt;NmnlVal&gt;         Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/NmnlVal&gt;       &lt;/Qty&gt;       &lt;Pric&gt;         &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;       &lt;/Pric&gt;     &lt;/Pric&gt;     &lt;TradVn&gt;XUSA&lt;/TradVn&gt;     &lt;UpFrntPmt&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000&lt;/Amt&gt;     &lt;/UpFrntPmt&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt; </pre>

<pre> &lt;FullNm&gt;DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SESPXC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2016-06-25&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;DE0008469008&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;DAX 30&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;ES0SI0000005&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;IBEX 35&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Othr&gt; &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;Id&gt;US000DAX000X&lt;/Id&gt; &lt;FullNm&gt;DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SESPXC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2016-06-25&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;DE0008469008&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;DAX 30&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;ES0SI0000005&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;IBEX 35&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	---

От друга страна инвестиционен посредник Y би могъл също да подаде отчет, който го представя като купувача вместо инвестиционен посредник X. В този случай знаците в основното поле трябва да бъдат променени съответно, т.е да показват кои (резултати от) основния инструмент купувачът получава и кои той трябва да плати.

### 5.35.7.3 Капиталов суап (два „крака“ на собствения капитал), търгуван извънборсово (инструментът не е наличен в списъка на ESMA)

#### Пример 108

Инвестиционен посредник X търгува извънборсово капиталов суап с инвестиционен посредник Y. Основните капиталови инструменти са допуснати до търговия на място на търговия. Договорът изтича на 25 юни 2016 г. и се заплаща в брой. Условната стойност съгласно споразумението за суап е 1000000 EUR. Липсва платен спред.

Един основен капиталов инструмент е Orange (ISIN FR0000133308).

Другият основен капиталов инструмент е Telefonica (ISIN ES0178430E18).

Пълното име на инструмента е поле за свободен текст, което се попълва от изпълняващия субект: ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16. CFI кодът за капиталов суап е SESPXC.

Инвестиционен посредник X получава резултатите за капиталов инструмент Orange и заплаща резултатите за капиталов инструмент Telefonica.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиция посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> ... <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
30	Количество	'1000000'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
31	Валута на количеството	'EUR'	</Id>
33	Цена	'0'	</AcctOwnr>
34	Валута на цената		</Buyr>
36	Място на провеждане	'XXXX'	<Sellr> <AcctOwnr> <Id>
41	Код за идентифициране на инструмент		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>
42	Пълно наименование на инструмента	'ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	</Id> </AcctOwnr> </Sellr>
43	Класификация на инструмента	{CFI код}	... <Tx>
44	Условна валута 1	'EUR'	... <Qty>
46	Множител на цената	'1'	



47	Код на базовия инструмент	'+'{Underlying Orange equity ISIN} '-'{Underlying Telefonica equity ISIN}	<pre> &lt;NmnlVal Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/NmnlVal&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;Othr&gt; &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;FullNm&gt;ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SESPXC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2016-06-25&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;ISIN&gt;FR0000133308&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;ISIN&gt;ES0178430E18&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
55	Дата на изтичане	25.06.2016	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник Y?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиция посредник Y	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<Tx> ... <New>
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	...

16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<pre> &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/ExctgPty&gt; y&gt; &lt;Buyr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt; &lt;AcctOwnr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; &lt;Tx&gt; &lt;Qty&gt; &lt;NmnlVal Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/NmnlVal&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pric&gt; &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt; &lt;Othr&gt; &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;FullNm&gt;ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SESPXC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2016-06-25&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;ISIN&gt;ES0178430E18&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;ISIN&gt;FR0000133308&lt;/ISIN&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; </pre>
30	Количество	'1000000'	
33	Цена		
34	Валута на цената	'EUR'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	
41	Код за идентифициране на инструмент		
42	Пълно наименование на инструмента	'ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	
44	Условна валута 1	'EUR'	
47	Код на базовия инструмент	'-'{Underlying Orange equity ISIN}'+{Underlying Telefonica equity ISIN}	
55	Дата на изтичане	25.06.2016	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

			... </New> </Tx>
--	--	--	------------------------

От друга страна инвестиционен посредник Y би могъл също да подаде отчет, който го представя като купувача вместо инвестиционен посредник X. В този случай знаците в основното поле трябва да бъдат променени съответно, т.е да показват кои (резултати от) основния инструмент купувачът получава и кои той трябва да плати.

#### 5.35.7.4 Суап за обща доходност, търгуван извънборсово (инструмент, който не е наличен в списъка на ESMA)

##### Пример 109

Инвестиционен посредник X търгува извънборсов суап за обща доходност върху австрийски търгуван индекс (ATX) с инвестиционен посредник Y. ISIN на ATX е: AT0000999982. Инвестиционен посредник X заплаща определения процент, дефиниран като EURIBOR 3M плюс 30 базисни точки, а инвестиционен посредник Y заплаща общата възвращаемост на индекса, включително доходът, който той генерира и всички капиталови печалби. Инвестиционен посредник Y продава суап за обща доходност, а инвестиционен посредник X купува договор за суап, тъй като инвестиционен посредник X печели от възвращаемостта на основния актив без физически да го притежава в замяна на определено плащане.

Договорът има условна сума в размер на 2000000 EUR и изтича на 15 декември 2018 г.

Съществува договорено авансово плащане в размер на 15000 EUR, което инвестиционен посредник X заплаща на инвестиционен посредник Y. CFI кодът е SEITXC, а договорът се заплаща в брой.

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	Доклад със стойности Инвестиционен посредник Y
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник Y
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	{LEI} на инвестиционен посредник Y
30	Количество	'2000000'	'2000000'
33	Цена	'30'	'30'
34	Валута на цената		
36	Място на провеждане	'XXXX'	'XXXX'
38	Авансово плащане	'15000'	'15000'
39	Валута на авансовото плащане	'EUR'	'EUR'
41	Код за идентифициране на инструмент		
42	Пълно наименование на инструмента	'TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS'	'TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI + 30BPS'
43	Класификация на инструмента	SEITXC	SEITXC

44	Условна валута	'EUR'	'EUR'
46	Множител на цената	'1'	'1'
47	Код на базовия инструмент	'+'{Underlying ATX index ISIN}	'+'{Underlying ATX index ISIN}
48	Наименование на базовия индекс	'-'{EURI index name}	'-'{EURI index name}
49	Срок на базовия индекс	'3MNTH'	'3MNTH'
55	Дата на изтичане	15.12.2018	15.12.2018
56	Вид на доставката	'Парични средства'	'Парични средства'

XML представителство:

Доклад от дружество X	Доклад от дружество Y
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnc&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnc&gt;       &lt;Id&gt;     ...   &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ...   &lt;Qty&gt;     &lt;NmnlVal&gt; Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;BsisPts&gt;30&lt;/BsisPts&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt;   &lt;UpFrntPmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;15000&lt;/Amt&gt;   &lt;/UpFrntPmt&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...  &lt;ExctgPty&gt;ABCDEFGHIJKLMNQPQRST&lt;/ExctgPty&gt;   ...   &lt;Buyr&gt;     &lt;AcctOwnc&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnc&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnc&gt;       &lt;Id&gt;     ...   &lt;/AcctOwnc&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt; ...   &lt;Qty&gt;     &lt;NmnlVal&gt; Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/Qty&gt;     &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;BsisPts&gt;30&lt;/BsisPts&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XXXX&lt;/TradVn&gt;   &lt;UpFrntPmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;15000&lt;/Amt&gt;   &lt;/UpFrntPmt&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Othr&gt;     &lt;FinInstrmGnlAttrbts&gt; </pre>

<pre> &lt;FullNm&gt;TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SCITSC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2018-12-15&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;AT0000999982&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;ATX&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Indx&gt;EURI&lt;/Indx&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;Term&gt; &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt; &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt; &lt;/Term&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;FullNm&gt;TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS&lt;/FullNm&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;SCITSC&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;NtnlCcy&gt;EUR&lt;/NtnlCcy&gt; &lt;/FinInstrmGnlAttrbts&gt; &lt;DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;XpryDt&gt;2018-12-15&lt;/XpryDt&gt; &lt;PricMltplr&gt;1&lt;/PricMltplr&gt; &lt;UndrlygInstrm&gt; &lt;Swp&gt; &lt;Swpln&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;ISIN&gt;AT0000999982&lt;/ISIN&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Nm&gt;ATX&lt;/Nm&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/Swpln&gt; &lt;SwpOut&gt; &lt;Sngl&gt; &lt;Indx&gt; &lt;Nm&gt; &lt;RefRate&gt; &lt;Indx&gt;EURI&lt;/Indx&gt; &lt;/RefRate&gt; &lt;Term&gt; &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt; &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt; &lt;/Term&gt; &lt;/Nm&gt; &lt;/Indx&gt; &lt;/Sngl&gt; &lt;/SwpOut&gt; &lt;/Swp&gt; &lt;/UndrlygInstrm&gt; &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--

5.35.7.5 Суап на „капиталова кошница“, търгуван извънборсово (инструмент, който не е наличен в списъка на ESMA)

#### Пример 110

Инвестиционен посредник X („платец на сумата на капиталовия инструмент“) сключва двугодишен, платим в брой извънборсов суап, свързан с капиталова кошница на 15 юни 2018 г. с инвестиционен посредник Y („платец по фиксиран курс“) на LIBOR 1 година при 3,7 % + 5

базисни точки. Инвестиционен посредник X е съгласен да заплати на падеж общия резултат на кошница с капиталови инструменти с четири акции (първоначална стойност на кошницата: 21,85 EUR) на инвестиционен посредник Y. Броят акции, попадащи в обхвата на споразумението за суап е 1000000, което води до условна стойност на капиталовия суап в размер на 21850000 EUR.

Кошницата се състои от четири капиталови инструмента, три от които се търгуват на място на търговия в ЕИП:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)
- Cargotec (ISIN FI0009013429)
- Intel Corporation (ISIN US4581401001)

Съгласно член 26, параграф 2, буква в) от Регламента за пазарите на финансови инструменти, американските капиталови инструменти в кошницата не се попълват в поле 47 (код на основния инструмент), тъй като той не се търгува на място на търговия в ЕИП.

Договорът изтича на 15 юни 2018 г. и CFI кодът е SEBPXC. Договорът се заплаща в брой.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
30	Количество	'21850000'	
31	Валута на количеството	'EUR'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
33	Цена	'5'	</Id>
34	Валута на цената		</AcctOwnr>
36	Място на провеждане	'XXXX'	</Buyr>
41	Код за идентифициране на инструмент		<Sellr> <AcctOwnr> <Id>
42	Пълно наименование на инструмента	'KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	</Id>
44	Условна валута 1	'EUR'	</AcctOwnr>
46	Множител на цената	'1'	</Sellr>
47	Код на базовия инструмент	'+' FI0009005870'	... <Tx> ... <Qty>

		'+' FI0009014575' '+' FI0009013429'	<NmnlVal Ccy="EUR">218550000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>5</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018</FullNm> <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN> <ISIN>FI0009013429</ISIN> </Bskt> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>YEAR</Unit> <Val>1</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
48	Наименование на базовия индекс	'-'LIBO'	
49	Срок на базовия индекс	'1 година'	
55	Дата на изтичане	15.06.2018	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

В този пример, инвестиционен посредник Y купува суап на капиталова кошница тъй като това дружество, инвестиционен посредник Y, получава резултатите за капиталовата кошница.

#### 5.35.7.6 Суап между две кошници извънборсово (инструмент, който не е наличен в списъка на ESMA)

##### Пример 111

Инвестиционен посредник X („платец на резултатите на кошница A“) сключва двугодишен, платим в брой извънборсов суап, свързан с капиталова кошница на 15 юли 2018 г. с инвестиционен посредник Y („платец на резултата на кошница B“). Инвестиционен посредник X е съгласен да заплати на падеж общия резултат на капиталова кошница A, а инвестиционен посредник Y е съгласен да заплати на падеж общия резултат на капиталова кошница B. Условната стойност на капиталовия суап е 10000000 EUR.

Капиталова кошница A има два капиталови инструмента (които се търгуват на място на търговия) и референтна стойност в размер на 16,10 EUR:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)

Капиталова кошница B обхваща два капиталови инструмента (които се търгуват на място на търговия) и референтна стойност в размер на 40,85 SEK:

- Elisa (ISIN FI0009007884)
- TeliaSonera (ISIN SE0000667925)

Договорът за суап изтича на 15 юли 2018 г. и съответният CFI код е SEBPXC.

Договорът за суап има спред '0'.

Докладите за сделки, показани по-долу, са от гледна точка единствено на инвестиционен посредник X.

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> y>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	... <Buyr> <AcctOwnr>
30	Количество	'10000000'	<Id>
31	Валута на количеството	'EUR'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
33	Цена	'0'	</Id>



34	Валута на цената		</AcctOwnr>
36	Място на провеждане	'XXXX'	</Buyr>
41	Код за идентифициране на инструмента		<Sellr>
42	Пълно наименование на инструмента	'RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018'	<AcctOwnr>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<Id>
44	Условна валута 1	'EUR'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
46	Множител на цената	'1'	</Id>
47	Код на базовия инструмент	''+'FI0009007884 ''+' SE0000667925 ''-'FI0009005870 ''-'FI0009014575'	</AcctOwnr>
55	Дата на изтичане	15.07.2018	</Sellr>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	...
			<Tx>
			...
			<Qty>
			<NmnlVal
			Ccy="EUR">10000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Pctg>0</Pctg>
			</Pric>
			</Pric>
			<TradVn>XXXX</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>RELATIVE
			PERFORMANCE SWAP XXX JULY
			2018</FullNm>
			<ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp>
			<NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<XpryDt>2018-07-25</XpryDt>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Swp>
			<Swpln>
			<Bskt>
			<ISIN>FI0009007884</ISIN>
			<ISIN>SE0000667925</ISIN>
			</Bskt>
			</Swpln>
			<SwpOut>
			<Bskt>
			<ISIN>FI0009005870</ISIN>
			<ISIN>FI0009014575</ISIN>
			</Bskt>
			</SwpOut>
			</Swp>
			</UndrlygInstrm>
			<DlvryTp>CASH</DlvryTp>
			</DerivInstrmAttrbts>
			</Othr>
			</FinInstrm>
			...
			</New>

			</Tx>
--	--	--	-------

Ако инвестиционен посредник Y подаде отчет, който го представя като купувача вместо инвестиционен посредник X., в този случай знаците в основното поле трябва да бъдат променени съответно, т.е. да показват кои (резултати от) основния инструмент купувачът получава и кои той трябва да плати.

#### 5.35.7.7 Обикновен лихвен суап, търгуван на място на търговия (инструментът присъства в списъка на ESMA)

##### Пример 112

Инвестиционен посредник X купува обикновен лихвен суап (ISIN XS0000000003) от инвестиционен посредник Y за условната сума от 100000000 GBP на място на търговия M. Датата на изтичане на суапа е 21 октомври 2025 г. Приемаме за простота, че договорът за суап има спред нула.

Инвестиционен посредник X заплаща 1,8655 %, полугодишно (действителен брой изминали дни/365F), а инвестиционен посредник Y заплаща 6-месечен GBP-LIBOR, полугодишно (действителен брой изминали дни/365F).

Договорът за суап има спред '0'.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на инвестиционен посредник X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник Y	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
30	Количество	'100000000'	
31	Валута на количеството	'GBP'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
33	Цена	'0'	</Id>
34	Валута на цената		</AcctOwnr>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място на търговия M	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
41	Код за идентифициране на инструмента	{ISIN} на инструмента	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ...

			<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;Qty&gt;     &lt;NmnlVal Ccy="GBP"&gt;100000000&lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XMIC&lt;/TradVn&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;FinInstrm&gt;   &lt;Id&gt;XS0000000003&lt;/Id&gt; &lt;/FinInstrm&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

Докладваната в поле 33 цена трябва да отговаря на стойността на фиксираната ставка в референтните данни на инструмента

## 5.35.8 Стокови деривати

### 5.35.8.1 Извънборсова опция върху борсово търгуван стоков фючърс

#### Пример 113

Инвестиционен посредник X купува 100 договора за „up-and-in“ американска бариерна кол опция върху Corn фючърсни договори. Цената на упражняване е 168 EUR, а датата на изтичане е 30 август 2018 г. Един договор за опция дава право на купувача на един Corn фючърсен договор.

Платената премия е 0,95 EUR.

Основният инструмент на договор за бариерна опция е фючърсен договор, търгуван на Euronext Paris при 170 EUR. Единицата на търгуване върху Corn фючърсен договор е 50 тона, а ISIN на договора е FR0000000000.

Бариерата е поставена при 172 EUR (договорът за опция влиза в сила само ако цената на основния фючърсен договор достигне бариерата).

CFI кодът на бариерната опция е HTFBBC, като договорът се изплаща в брой.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности #1 Инвестиционен посредник X	XML представителство
---	------	--	----------------------

4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
30	Количество	'100'	
33	Цена	'0.95'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
34	Валута на цената	'EUR'	
36	Място на провеждане	'XXXX'	...
41	Код за идентифициране на инструмент		<Tx> ...
42	Пълно наименование на инструмента	'UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORNFUTURES CONTRACT'	<Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">0.95</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	<TradVn>XXXX</TradVn>
46	Множител на цената	'1'	</Tx>
47	Код на базовия инструмент	{ ISIN }на Corn Future	<FinInstrm>
50	Вид на опцията	'КОЛ'	<Othr>
51	Цена на упражняване	'168'	<FinInstrmGnlAttrbts>
52	Валута на цената на упражняване	'EUR'	<FullNm>UP AND IN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORN FUTURES CONTRACT</FullNm>
53	Стил на упражняване на опция	'AMER'	<ClssfctnTp>HTFBBC</ClssfctnTp>
55	Дата на изтичане	30.08.2018	</FinInstrmGnlAttrbts>
56	Вид на доставката	'Парични средства'	<DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-08-30</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndryglInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>FR0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndryglInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">168</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric>
			<OptnExrcStyle>AMER</OptnExrcStyle> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Основният инструмент на бариерната опция е Corn фючърсен договор и следователно поле 47 се попълва с идентификатора на Euronext Corn фючърсен договор.

Полетата с референтни данни на инструмента в отчета за сделката описват бариерната опция.

#### 5.35.8.2 Договор за квоти за емисии

##### Пример 114

Инвестиционен посредник X купува 3000 EU квоти за емисии по 7,50 EUR на регулиран пазар Европейска енергийна борса (MIC XEEE).

ISIN на инструмента е DE000A1DKQ99.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>3000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.50</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A1DKQ99</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
30	Количество	'3000'	
33	Цена	'7.50'	
34	Валута на цената	'EUR'	
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на платформа за търговия	
41	Код за идентифициране на инструмент	{ ISIN} на Emission Allowance contract	

#### 5.35.8.3 Фючърсен договор върху квоти за емисии

##### Пример 115

Инвестиционен посредник X купува 5 фючърсни договора за квоти за емисии от ЕС (1 фючърсен договор представлява 1000 CO2 квоти от ЕС) при 7,90 EUR на регулирания пазар Европейска енергийна борса (MIC XEEE).

ISIN на фючърския договор за квоти за емисии е DE000A0SYVA6.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
30	Количество	'5'	
33	Цена	'7,90'	
34	Валута на цената	'EUR'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място за търговия	... <Tx>
41	Код за идентифициране на инструмент	{ISIN} на фючърсен договор	... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.90</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A0SYVA6</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

#### 5.35.8.4 Извънборсова опция върху борсово търгуван фючърс за квоти за емисии

##### Пример 116

Инвестиционен посредник X купува 5 договора за извънборсови европейски кол опции върху борсово търгуван фючърс върху квоти за емисии. Платената премия е 1,00 EUR и договорът за опция изтича на 31 декември 2018 г. Тази опция не е търгувана на място на търговия, нито има ISIN код.

Множителят на цената (броят фючърси, представени в един договор) е 10, а цената на упражняване (цената, при която фючърсът е закупен или продаден, когато опцията е упражнена) е 8,00 EUR.

Фючърсът върху квоти за емисии се търгува на регулирания пазар Европейска енергийна борса (MIC XEEE), а ISIN кодът е DE000A0SYVA6.

CFI кодът за кол опцията е HTFAVC, а договорът се заплаща в брой.

Как трябва да се отчита инвестиционен посредник X?

N	Поле	Доклад със стойности Инвестиционен посредник X	XML представителство
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	<Tx> <New> ...
30	Количество	'5'	
33	Цена	'1.00'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
34	Валута на цената	'EUR'	...
36	Място на провеждане	'XXXX'	<Tx> ...
41	Код за идентифициране на инструмент		<Qty> <Unit>5</Unit> </Qty>
42	Пълно наименование на инструмента	'XXX КОЛ ОПЦИЯ'	<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal>
43	Класификация на инструмента	{CFI code}	</Pric> </Pric>
46	Множител на цената	'10'	<TradVn>XXXX</TradVn>
47	Код на базовия инструмент	{ISIN} на базовия фючърсен договор	</Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>XXX CALL
50	Вид на опцията	'КОЛ'	OPTION</FullNm>
51	Цена на упражняване	'8.00'	<ClssfctnTp>OCEFCS</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>10</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl>
52	Валута на цената на упражняване	'EUR'	<ISIN>DE000A0SYVA6</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal>
53	Стил на упражняване на опция	'EURO'	
55	Дата на изтичане	31.12.2018	
56	Вид на доставката	'Парични средства'	

			<pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;8.00&lt;/Amt&gt; &lt;/MntryVal&gt; &lt;/Pric&gt; &lt;/StrkPric&gt;  &lt;OptnExrcStyle&gt;EURO&lt;/OptnExrcStyle&gt; &lt;DivryTp&gt;CASH&lt;/DivryTp&gt; &lt;/DerivInstrmAttrbts&gt; &lt;/Othr&gt; &lt;/FinInstrm&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
--	--	--	--

Основният инструмент на кол опцията е фючърсен договор за квоти за емисии и следователно поле 47 се попълва с ISIN на този фючърсен договор.

### 5.35.9 Сложни сделки

Член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията се прилага единствено, когато инвестиционен посредник изпълнява сделка, която включва два или повече финансови инструмента (т.е. сложна сделка). Това означава, че за целта на отчитане на сделка, сделката следва единствено да бъде отчетена като включваща два или повече финансови инструмента, когато съществува една сделка с множество финансови инструменти едновременно за една цена (напр. покупката на един „договор за къса пеперуда“, който се състои от различни кол опции). Всички полета, непоказани в примера, трябва да бъдат попълнени за сложната сделка (напр. стратегии и структурирани продукти), а не действителните „крака“.

#### Пример 117

Инвестиционен посредник X желае да създаде къса стратегия „пеперуда“, която се състои от два къси кола за 1075 финансови инструмента и един дълъг кол за 2150 финансови инструмента. Той въвежда две поръчки за продажба и една поръчка за покупка в системата за търговия Eurex, където тя е изпълнена като една стратегическа сделка с единична цена.

N	Поле	Стойности Доклад # 1	Стойности Доклад # 2	Стойности Доклад # 3
2	Референтен номер на транзакция	89127	89128	89129
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент	{LEI} на дружество X	{LEI} на централен контрагент
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на централен контрагент	{LEI} на инвестиционен посредник X
30	Количество	'1075'	'2150'	'1075'
33	Цена	'40'	'40'	'40'



36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място за търговия	Сегмент {MIC} на място за търговия	Сегмент {MIC} на място за търговия
40	Идентификационен код на компонент за сложна сделка	'12345'	'12345'	'12345'

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2	Доклад # 3
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;89127&lt;/TxId&gt;      &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;1075&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="..."&gt;40&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XEUR&lt; /TradVn&gt;    &lt;CmplxTradCmpntId&gt;12345&lt;/ CmplxTradCmpntId&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;89128&lt;/TxId&gt;      &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;2150&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="..."&gt;40&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XEUR&lt; /TradVn&gt;    &lt;CmplxTradCmpntId&gt;12345&lt;/ CmplxTradCmpntId&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     &lt;TxId&gt;89129&lt;/TxId&gt;      &lt;ExctgPty&gt;1234567890123456 7890&lt;/ExctgPty&gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Buyr&gt;   &lt;Sellr&gt;     &lt;AcctOwnr&gt;       &lt;Id&gt;      &lt;LEI&gt;12345678901234567890 &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/AcctOwnr&gt;   &lt;/Sellr&gt;   ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;1075&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="..."&gt;40&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XEUR&lt; /TradVn&gt;    &lt;CmplxTradCmpntId&gt;12345&lt;/ CmplxTradCmpntId&gt;   &lt;/Tx&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>

	</Tx>	
--	-------	--

### Пример 118

Инвестиционен посредник X продава 10 Bund фючърси върху Eurex облигации (XEUR) и едновременно купува съответен брой основни германски правителствени облигации. Тези „крака“ на сделка са част от стратегическа сделка (базисна търговия) и се търгуват за единична цена от 20 EUR.

ISIN кодът за фючърс върху облигация е DE0000000000, а ISIN кодът на основната облигация е DE0000000001.

Тази сделка следва да бъде отчетена в два отделни отчета за сделки, като всеки отразява сделката за един от финансовите инструменти, които образуват стратегията. И двата отчета за сделки трябва да бъдат свързани с вътрешен код, който да бъде попълнен в поле 40, който е уникален за отчетите за сделките, свързани със същата стратегия.

Докладите за сделки, показани по-долу, са от гледна точка единствено на инвестиционен посредник X.

N	Поле	Доклад със стойности #1	Доклад със стойности #2
4	Идентификационен код на изпълняващия субект	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на инвестиционен посредник X
7	Код за идентифициране на купувач	{LEI} на централен контрагент	{LEI} на инвестиционен посредник X
16	Код за идентифициране на продавач	{LEI} на инвестиционен посредник X	{LEI} на централен контрагент
30	Количество	'10'	'1000000'
33	Цена	'20'	'20'
34	Валута на цената	'EUR'	'EUR'
36	Място на провеждане	Сегмент {MIC} на място за търговия	Сегмент {MIC} на място за търговия
40	Идентификационен код на компонент за сложна сделка	'12345'	'12345'
41	Код за идентифициране на инструмент	{Bond Futures contract ISIN}	{ISIN на облигация}

XML представителство:

Доклад # 1	Доклад # 2
<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt; </pre>	<pre> &lt;Tx&gt;   &lt;New&gt;     ...   &lt;ExctgPty&gt;12345678901234567890&lt;/ExctgPty&gt;   &gt;     &lt;Buyr&gt;       &lt;AcctOwnr&gt;         &lt;Id&gt; </pre>

<pre> &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;10&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;20&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XEUR&lt;/TradVn&gt;  &lt;CmplxTradCmpntId&gt;12345&lt;/CmplxTradCmpnt Id&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;     &lt;Id&gt;DE0000000000&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>	<pre>       &lt;LEI&gt;12345678901234567890&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Buyr&gt; &lt;Sellr&gt;   &lt;AcctOwnr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/AcctOwnr&gt; &lt;/Sellr&gt; ... &lt;Tx&gt;   ...   &lt;Qty&gt;     &lt;Unit&gt;1000000&lt;/Unit&gt;   &lt;/Qty&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;Pric&gt;       &lt;MntryVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;20&lt;/Amt&gt;       &lt;/MntryVal&gt;     &lt;/Pric&gt;   &lt;/Pric&gt;   &lt;TradVn&gt;XEUR&lt;/TradVn&gt;  &lt;CmplxTradCmpntId&gt;12345&lt;/CmplxTradCmpnt Id&gt;   &lt;/Tx&gt;   &lt;FinInstrm&gt;     &lt;Id&gt;DE0000000001&lt;/Id&gt;   &lt;/FinInstrm&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Tx&gt; </pre>
---	--

## 6 Насоки за документиране на поръчки

### Част I – Общи принципи

#### 6.1 Обхват на изискванията за документиране на поръчки

Съгласно член 25, параграф 2, изискванията за документиране на поръчки се прилагат за оператори на места на търговия по отношение на „всички поръчки за финансови инструменти, рекламирани чрез системите им“.

Те се прилагат по отношение на „поръчки“, които включват тези, които са активни, неактивни, преустановени, имплицитни и пренасочени поръчки, както и промени на поръчки, отменени и отхвърлени поръчки. Те се прилагат също за определени и индикативни котировки.

## 6.2 Членове или участници на място на търговия

В ДПФИ II и Регламента за пазарите на финансови инструменти, има няколко разпоредби, които се отнасят до „член или участник“ на място на търговия. Значението на „място на търговия“ е определено в член 4, параграф 1, точка 24 от ДПФИ II и обхваща регулираните пазари, многостранни системи за търговия (МСТ) и организирани системи за търговия (ОСТ). Все пак, необходима е допълнителна яснота относно значението на „член или участник“ на място на търговия за целите на член 50 от ДПФИ II и член 25, параграф 2 от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

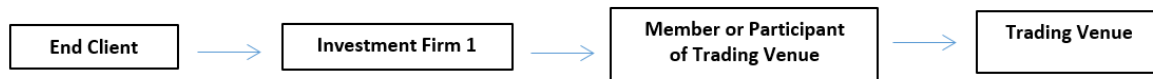
Термините „член“ и „участник“ се използват по принцип в контекста на регулираните пазари и многостранните търговски системи. Съображение 16 на ДПФИ II разяснява, че „лицата с достъп до регулираните пазари или многостранните търговски системи са посочени като членове или участници. И двата термина могат да бъдат използвани като взаимно заменяеми...“

Все пак, различна методология се използва за организираните системи за търговия, което отразява факта, че свързаните с клиенти задължения съгласно ДПФИ се прилагат за оператори на организирани системи за търговия, за разлика от оператори на многостранни системи за търговия и механизъм за докладване“. Например, член 18, параграф 7 от ДПФИ II посочва, че многостранните системи за търговия и организираните системи за търговия следва да имат „поне три съществено активни членове или потребители“. Като член 20 от ДПФИ II съдържа забрана срещу организирана система за търговия, която изпълнява „поръчки на клиенти срещу собствения капитал на организираната система за търговия. И в двата случая, изглежда, че терминът „потребител“ и „клиент“ се използват взаимно заменяеми, когато се отнася за организирана система за търговия и следователно те са аналогични с термините „член“ или „участник“.

Като се има предвид, че организираните системи за търговия са включени в обхвата на Регламента относно пазарната злоупотреба и като се има предвид нуждата от прилагане на изискванията на ДПФИ II/ Регламента за пазарите на финансови инструменти последователно за различни видове места на търговия, термините „член или участник“ в Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията (документиране на поръчки) и Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията (синхронизиране на часовник) следва да бъдат считани като включващи клиентите или потребителите на организирани системи за търговия.

## 6.3 Код за идентифициране на клиент (поле 3)

Код за идентифициране на клиент (поле 3) се използва за идентифициране на клиента на члена или участник. Единствено LEI или {NATIONAL\_ID}, според случая, на непосредствения клиент на члена или участника на мястото на търговия следва да бъде попълнен в поле 3. Задължението за поддържане на код за идентифициране на клиент (поле 3) нито изисква местата на търговия да регистрират клиентския идентификационен номер на крайния клиент, нито който и да е друг клиентски идентификационен номер на посредниците във веригата от непосредствения клиент на члена или участника до крайния клиент. Схемата по-долу илюстрира гореспоменатото обяснение: клиента на члена или участника на мястото на търговия е инвестиционен посредник 1.



End client	Краен клиент
Investment Firm 1	Инвестиционен посредник 1
Member of Participant of Trading Venue	Член на участник на място на търговия
Trading Venue	Място на търговия

Операторите на местата на търговия следва да поискат идентификатора на клиент на непосредствения клиент от неговия член или участник и да попълнят поле 3 с този клиентски идентификационен номер.

В случай че клиентският идентификационен номер не е събран по времето, когато поръчката е подадена до оператора на място на търговия, операторът следва да получи липсващия клиентски идентификационен номер възможно най-скоро и не по-късно от края на работния ден след подаването на поръчката.

За клиенти, мястото на търговия следва да провери, че осигуреният идентификационен код не съдържа очевидни грешки и пропуски.

### 6.3.1 Попълване на поле 3 (код за идентифициране на клиент) в случай на обобщени поръчки

Когато разпределението се е осъществило и клиентите са идентифицирани преди предаването на поръчката до член или участник на място на търговия за изпълнение, но поръчките на няколко клиента са обобщени от члена или участника на място на търговия, от оператора на мястото на търговия е поискано да попълни поле 3 с референция по подразбиране „AGGR“.

### 6.3.2 Попълване на поле 3 (код за идентифициране на клиент) в случай на предстоящи разпределения

В извънредния случай на разпределение, което е висящо по времето на подаване на поръчката и когато приложимото национално законодателство позволява разпределението на поръчката да се осъществи след нейното подаване, от оператора на място на търговия е поискано да попълни поле 3 с референция по подразбиране „PNAL“ за подобна поръчка. Съответният оператор на място на търговия не се изисква впоследствие да осигурява клиентски идентификационен номер на мястото на разпределение на поръчки до единични клиенти.

## 6.4 Неизпълняващ нарежданията посредник (поле 6)

Дейността на неизпълняващ нарежданията посредник е различна от пряк електронен достъп (ПЕД), както е определено съгласно член 4, параграф 1, точка 41 от ДПФИ II. Член 2, параграф 1, буква г) от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията заедно с поле 6 предвижда, че тази услуга възниква, когато член или участник на място на търговия (неизпълняващ нарежданията

посредник) насочи поръчка до място на търговия от името и на името на друг член или участник на мястото на търговия.

#### Пример 119

Инвестиционен посредник X подава поръчка за изпълнение до място на търговия M чрез неизпълняващ нарежданията посредник инвестиционен посредник Y от името на клиент Z.

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	{LEI} на инвестиционен посредник X, който е член на място на търговия M	
2	Пряк електронен достъп (ПЕД)	ГРЕШНО	
3	Код за идентифициране на клиент	{НАЦИОНАЛЕН Идентификационен номер} на физическо лице Z	
6	неизпълняващ нареждания посредник	{LEI} на инвестиционен посредник Y	
<b>Раздел Б - Качеството, в което лицето търгува и осигуряване на ликвидност</b>			
7	Качеството, в което лицето търгува	АОТС	Инвестиционен посредник X действа от името на клиент Z

## 6.5 Статус на нареждането (Поле 33)

Статусът на поръчка следва да бъде празен за отмяна, отхвърляне, изтичане и изцяло изпълнени събития, тъй като те вече не присъстват в регистъра с поръчки на място на търговия.

## 6.6 Дата и час на периода на валидност (Поле 12)

- i. По отношение на поръчки от типа „Веднага или никога“ и „Изпълни или отмени“, поле 12 (дата и време на периода на валидност) следва да бъде оставено празно за поръчки „Веднага или никога“ и „Изпълни или отмени“ (вж. поле 10 — период на валидност). Това е защото тези типове поръчки са предвидени да бъдат изпълнени незабавно при вписване в регистъра с поръчки (или изцяло, в случая с „Изпълни или отмени“ или в максималното възможно количество, в случая с поръчки „Веднага или никога“).
- ii. По отношение на категория „Други“, позоваването на удостоверенията за дата и време за „други“ типове периоди на валидност означава всеки друг тип на периода на валидност, който не е конкретно посочен в поле 10 (период на валидност). В този

случай, поле 10 следва да бъде попълнено с уникален четирибуквен код, който представлява този специфичен вид период на валидност и поле 12 следва да бъде попълнено.

## 6.7 Пасивен или агресивен показател (поле 44)

Това поле следва да бъде попълнено единствено за изпълнения, които се случват по време на продължителни сесии на търговия, иначе следва да остане празно. Това е защото поръчка не би била нито пасивна, нито агресивна по време на периоди на наддаване.

## 6.8 Идентификационен код на сделка на място на търговия (TVTIC) (поле 48)

Съгласно член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията, операторите на места на търговия следва да поддържат индивидуален „Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия“ (TVTIC) за всяка сделка в резултат на пълното или частично изпълнение на поръчка, както е посочено в поле 48.

Следователно, операторите на място на търговия следва винаги да генерират „Идентификационен код на сделка на място на търговия“ (TVTIC) за всяка сделка, изпълнена на тяхното място на търговия, която възниква от поръчка за финансов инструмент, рекламиран чрез техните системи. При горепосочените обстоятелства, операторът на място на търговия следва да отчете следователно съответния TVTIC като попълни поле 48.

## 6.9 Пореден номер (поле 15)

Поредният номер се използва за определяне кое събитие се е случило първо на място на търговия, когато две събития имат едно и също удостоверение за време. Местата на търговия следва да гарантират, че всяко от конкретните събития, посочени в поле 21 в колоните за съдържание и формат, следва да получи пореден номер. Фазите на търговия, посочени в раздел 6.13.9 са обхванати от събитие „промяна на статуса поради пазарни операции“, посочено в поле 21. Следователно местата на търговия следва да попълват поредния номер за промените във фазите на търговия.

Някои места на търговия могат да работят с множество основни софтуерни компоненти за балансиране на товарите в техните системи. В този случай, поредният номер следва да бъде уникален за всяко събитие и последователен за всички събития за този основен софтуерен компонент.

Предоставени са следните примери:

1. Неправилно използване, когато поредният номер е определен за един регистър с поръчки
2. Неправилно използване, когато поредният номер изглежда уникален за поръчка
3. Коректно използване на поредния номер

За примери 77 и 78 по-долу, основният софтуерен компонент на мястото на търговия съдържа повече от един регистър с поръчки и множество събития се случват в двата регистъра с поръчки.

Пример 120: Неправилно използване, когато поредният номер е определен за един регистър с поръчки

Тук изглежда, че поредният номер е определен за един регистър с поръчки. Това не е приемливо, защото означава, че компетентните органи не биха могли да консолидират събития, които се случват в множество регистри с поръчки в същия основен софтуерен компонент. Например: консолидиращи събития в същия финансов инструмент в светли и тъмни регистри.

Правилните поредни номера следва да бъдат 1,2,3,4,5,6,7.

Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение (поле 21)	Код за регистриран е на нареждане (Поле 17)	Код за идентифициране на нареждане (Поле 20)	Пореден номер (Поле 15)	Дата и час
NEWO	Регистър с поръчките 1	ABC	1	07.03.2018 г., 08:30:26.548921 ч.
NEWO	Регистър с поръчките 2	GHI	1	07.03.2018 г., 08:30:26.548936 ч.
CHME	Регистър с поръчките 1	ABC	2	07.03.2018 г., 08:30:26.598721 ч.
NEWO	Регистър с поръчките 2	TUV	2	07.03.2018 г., 08:30:26.598731 ч.
NEWO	Регистър с поръчките 1	DEF	3	07.03.2018 г., 08:30:26.975621 ч.
CAME	Регистър с поръчките 1	ABC	4	07.03.2018 г., 08:30:27.025489 ч.
CAME	Регистър с поръчките 1	DEF	5	07.03.2018 г., 08:30:27.025489 ч.

Пример 121: Неправилно използване, когато поредният номер изглежда уникален за поръчка

Следователно, поредният номер изглежда уникален за поръчката, а не за основния софтуерен компонент.



Правилните поредни номера следва да бъдат 1,2,3,4,5.

Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение (поле 21)	Код за идентифициране на нареждане (Поле 20)	Пореден номер (Поле 15)	Дата и час (Поле 9)	Коментар
NEWO	ABC	1	07.03.2018 г., 08:30:26.5489 21 ч.	Поредният номер е определен само за поръчката, така че всяко събитие за поръчка за тази поръчка увеличава поредния номер. Това не е правилно тъй като поредният номер следва да бъде уникален за всяко събитие и последователен за всички събития.
CHME	ABC	2	07.03.2018 г., 08:30:26.5987 21 ч.	
NEWO	DEF	1	07.03.2018 г., 08:30:26.9756 21 ч.	Тъй като това е различна поръчка, поредният номер започва с едно.
CAME	ABC	3	07.03.2018 г., 08:30:27.0254 89 ч.	
CAME	DEF	2	07.03.2018 г., 08:30:27.0254 89 ч.	Удостоверението за време е същото като предишното събитие. Все пак, ако компетентните органи са сортирали поредните номера във възходящ ред, то би изглеждало, че това събитие се е случило преди събитието по-горе, но случаят не е такъв.

Пример 122: Коректно използване на пореден номер

В този пример, всички събития се допуска, че се случват в същия регистър с поръчки и мястото на търговия има един основен софтуерен компонент.

Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение (поле 21)	Код за идентифициране на нареждане (Поле 20)	Пореден номер (Поле 15)	Дата и час (Поле 9)	Коментар
NEWO	ABC	25897	07.03.2018 Г., 08:30:26.548 921 ч.	Поредният номер е генериран за регистрите с поръчки на мястото на търговия. Следователно, поредният номер може да се увеличи с повече от 1 при разглеждане на събития в един регистър с поръчки.
CHME	ABC	26589	07.03.2018 Г., 08:30:26.598 721 ч.	Поредният номер се е увеличил с повече от един, тъй като основният софтуерен компонент е обработил други събития в други регистри с поръчки, но все още е уникално, положително цяло число във възходящ ред.
NEWO	DEF	26751	07.03.2018 Г., 08:30:26.975 621 ч.	
CAME	ABC	27465	07.03.2018 Г., 08:30:27.025 489 ч.	
CAME	DEF	27466	07.03.2018 Г., 08:30:27.025 489 ч.	Удостоверението за време е същото като предишното събитие. Все пак, поредният номер позволява на компетентните органи да определят, че това събитие

				се е случило след събитието в реда по-горе.
--	--	--	--	---

## 6.10 Период на валидност (поле 10)

### 6.10.1 Дневен флаг (DAVY)

#### Пример 123

Инвестиционен посредник X подава поръчка за изпълнение до място на търговия M с дневен флаг (DAVY) на 16 януари 2018 г.

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията			
10	Период на валидност		DAVY
12	Дата и час на периода на валидност		16.01.2018 г., 23:59:59.999999 ч.

### 6.10.2 Комбинация от два флага на периода на валидност Нареждания, валидни след дата (GADV) и нареждания, валидни до дата (GTDV)

#### Пример 124

Инвестиционен посредник X подава поръчка за изпълнение до място на търговия M с флагове „валидна след дата“ (GADV) и „валидна до дата“ (GTDV) на 16 януари 2018 г. в 10:05:32.278932 ч. (координирано универсално време). При подаване, периодът на валидност следва да бъде GADV, а датата и часът на периода на валидност следва да бъдат 19 януари 2018 г. с регистриран час 00:00:00 ч. (с част от секундата, регистрирана съгласно член 50 от ДПФИ II) или за начало на търговия на това място на търговия (събитие 1). На 19 януари 2018 г., периодът на валидност следва да бъде GTDV, а датата и часът на периода на валидност следва да бъдат 13 февруари 2018 с регистриран час 23:59:59 (с част от секундата, регистрирана съгласно член 50 от ДПФИ II) (събитие 2).

**Събитие 1:** Подаване на поръчката за изпълнение

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час		16.01.2018 г., 10:05:32.278932 ч.
Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията			

10	Период на валидност	GADV
12	Дата и час на периода на валидност	19.01.2018 г., 00:00:00.000001 ч. <sup>36</sup>
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	NEWO
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
33	Статус на поръчката	INAC <sup>37</sup>

**Събитие 2:** Нарездането става активно

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	19.01.2018 г., 00:00:00.000001 ч. <sup>38</sup>
<b>Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>		
10	Период на валидност	GTDV
12	Дата и час на периода на валидност	13.02.2018 г., 23:59:59.999999 ч.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	CHMO <sup>39</sup>
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
33	Статус на поръчката	ACTI

## 6.11 Дейност за осигуряване на ликвидност (Поле 8)

Дейността за осигуряване на ликвидност от членове или участници на места на търговия по принцип се случва в един от следните три сценария:

- член или участник осъществява алгоритмична търговия за изпълнение на стратегия по поддържане на пазара и, в резултат, сключва споразумение с място на търговия съгласно член 17 и член 48 от ДПФИ II;

<sup>36</sup> Или въведете всяко друго удостоверение за време преди началото на търговията и/или началния търг.

<sup>37</sup> При подаване на поръчка до мястото на търговия, поръчката е неактивна поради GADV период на валидност.

<sup>38</sup> Или въведете всяко друго удостоверение за време преди началото на търговията и/или началния търг.

<sup>39</sup> Активирането на нареждане се счита за промяна на статус поради пазарни операции.

- б) член или участник, който осъществява дейност по осигуряване на ликвидност (която не е обхваната като стратегия по поддържане на пазара съгласно член 17 от ДПФИ II) търгува за собствена сметка съгласно споразумение с емитента или мястото на търговия;
- в) член или участник, който осъществява дейност по осигуряване на ликвидност, изпълнява поръчки от името на клиенти съгласно споразумение с емитента или мястото на търговия.

Дейностите за осигуряване на ликвидност, изброени в букви а) - в), следва да бъдат отразени в регистъра на място на търговия чрез подходящото попълване на поле 7 (свързано с търговия качество), поле 8 (осигуряване на ликвидност) и поле 3 (код за идентифициране на клиент), ако се осъществяват поръчки от името на клиенти.

Пример 125

Сценарий	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Дейност съгласно а)	Раздел Б - Качеството, в което лицето търгува и осигуряване на ликвидност	
	7. Качеството, в което лицето търгува	DEAL
	8. Дейност за осигуряване на ликвидност	true
Дейност съгласно б)	Раздел Б - Качеството, в което лицето търгува и осигуряване на ликвидност	
	7. Качеството, в което лицето търгува	DEAL
	8. Дейност за осигуряване на ликвидност	true
Дейност съгласно в)	Раздел А - Идентификация на съответните страни	
	3. Код за идентифициране на клиент	{LEI} или {NATIONAL_ID}
	Раздел Б - Качеството, в което лицето търгува и осигуряване на ликвидност	
	7. Качеството, в което лицето търгува	AOTC

	8. Дейност за осигуряване на ликвидност	true
--	---	------

## Част II – Сценарии

### 6.12 Легенда

Освен ако е посочено друго в конкретния сценарий, следната допълнителна информация е в сила за всички сценарии, посочени в част II:

Инвестиционен посредник X (LEI: 12345678901234567890) е член или участник на място на търговия M.

Инвестиционен посредник Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) е член или участник на място на търговия M.

Сегментът MIC на място на търговия M е 'XMIC'.

Място на търговия M има закъснение „от вход до вход“ по-малко от 1 милисекунда.

ISIN на финансовия инструмент е: XX0000000000

Кодът за идентифициране на нареждане е: 123456789ABC

Кодът за регистриране на нареждане при място на търговия M е: XYZ9876

Генерираният идентификационен код на сделка на място на търговия M е: ABC123456

В допълнение, всички полета в таблицата от полета на Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията са задължителни. Полетата следва единствено да бъдат оставени празни, когато не са значими за конкретно събитие. Например, поле 14 Размер на приоритета не е значимо за регистъра с поръчки за приоритет за цена и време и не се очаква да бъде попълнено. Бизнес казусите могат да се съсредоточат единствено върху полета, за които е необходимо разяснение. Без значение на техническия формат, в който данните са предоставени (напр. XML, CSV и други), ако дадено поле може да остане празно, информацията следва да бъде осигурена по начин, който позволява на компетентния орган да определи, че това поле е останало празно.

### 6.13 Централен регистър с лимитирани поръчки

Насоките за централния регистър с лимитирани поръчки обхващат следните сценарии:

- Подраздел 6.14.1: Нови/отмяна/промяна на поръчки
- Подраздел 6.14.2: Цена на допълнителен лимит
- Подраздел 6.14.3: Класификация на лимитирана поръчка „айсберг“

- г) Подраздел 6.14.4: Пазарно обвързани поръчки
- д) Подраздел 6.14.5: Класификация на стоп поръчка
- е) Подраздел 6.14.6: Насочени поръчки
- ж) Подраздел 7.14.6: Класификация на поръчки, подадени съгласно стратегия
- з) Подраздел 8.14.6: Промяна на приоритет
- и) Подраздел 9.14.6: Фази на търговия

### 6.13.1 Нови/отмяна/промяна на поръчки (поле 21)

#### 6.13.1.1 Получаване на ново нареждане

Дори ако поръчката е изпълнена при нейното регистриране в регистъра с поръчки, първото събитие за отчитане е „Нова поръчка“.

#### Пример 126

Инвестиционен посредник X подава лимитирана поръчка за покупка за изпълнение (покупка на 1000 акции от финансовия инструмент при 80,00 EUR) до място на търговия M на 16 януари 2018 г. Информацията е получена от основния софтуерен компонент на място на търговия M в 08:05:32.278932(координирано универсално време).

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час		16.01.2018 г., 08:05:32.278932 ч.
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>			
16	Код на сегмент MIC		XMIC
17	Код за регистриране на нареждане		XYZ9876
18	Идентификационен код на финансови инструменти		XX0000000000
19	Дата на получаване		16.01.2018 г.
20	Код за идентифициране на нареждане		123456789ABC
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение		NEWO
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането		Лимит

23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>		
24	Лимитирана цена	80.00
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
36	Първоначално количество	1000
37	Останалото количество, включително скрито	1000
38	Визуализирано количество	1000
39	Търгувано количество	0

#### 6.13.1.2 Промяна на нареждане от член или участник

##### Пример 127

Инвестиционен посредник X подава промяна на цената (промяна до 81,00 EUR) на гореспоменатата поръчка до място на търговия M (покупка на 1000 акции от ISIN XX0000000000 при 80,00 EUR) на 16 януари 2018 г. Искането за промяна е получено от основния софтуерен компонент на място на търговия M в 14:47:55.179524(координирано универсално време). Промяната на поръчката е поискана от клиента на инвестиционен посредник X.

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
N	Поле	
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	16.01.2018 г., 14:47:55.179524 ч.
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>		
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	REME
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>		
24	Лимитирана цена	81.00
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
36	Първоначално количество	1000
37	Останалото количество, включително скрито	1000
38	Визуализирано количество	1000
39	Търгувано количество	0



### 6.13.1.3 Частично изпълнена поръчка

#### Пример 128

Променената поръчка за 1000 акции от ISIN XX0000000000 при 81,00 EUR (вж. подраздела по-горе) е частично изпълнена (200 акции от ISIN XX0000000000 при 81,00 EUR ) на същия ден, т.е. 16 януари 2018 г. в 14:48:11.544378 ч. (координираното универсално време).

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	16.01.2018 г., 14:48:11.544378 ч.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	PARF
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>		
24	Лимитирана цена	81.00
28	Цена на сделката	81.00
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
36	Първоначално количество	1000
37	Оставащо количество	800
38	Визуализирано количество	800
39	Търгувано количество	200
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	ABC123456

### 6.13.1.4 Изцяло изпълнена поръчка

#### Пример 129

Частично изпълнената поръчка за останалото количество от 800 акции от ISIN XX0000000000 при 81,00 EUR (вж. подраздела по-горе) след това се изпълнява изцяло (800 акции от ISIN XX0000000000 при 81,00 EUR) на същия ден, т.е. 16 януари 2018 г. в 14 ч.: 50:20.379545(координирано универсално време).

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
N	Поле	
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	16.01.2018 г. 14:50:20.379545 ч.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	FILL
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>		
24	Лимитирана цена	81.00
28	Цена на сделката	81.00
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
36	Първоначално количество	1000
37	Оставащо количество	0
38	Визуализирано количество	0
39	Търгувано количество	800
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	ABC789000

#### 6.13.1.5 Отмяна на нареждане

##### Пример 130

Инвестиционен посредник X подава искане за отмяна по отношение на поръчка за продажба на 2000 акции от ISIN XX0000000000 по 50,00 EUR до място на търговия M на 18 януари 2018 г. в 14:12:34(координирано универсално време). Искането за отмяна е получено от основния софтуерен компонент на място на търговия M в 14:12:34.112856(координирано универсално време). Отмяната на поръчката е поискана от клиента на инвестиционен посредник X.

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
N	Поле	
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	18.01.2018 г., 14:12:34.112856 ч.
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>		
20	Код за идентифициране на нареждане	987654321ABC

Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането		
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	CAME
Раздел З — Тип на нареждането		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
Раздел И - Цени		
24	Лимитирана цена	50.00
Раздел Й - Инструкции за нареждането		
32	Показател за покупка-продажба	SELL
33	Статус на поръчката <sup>40</sup>	
36	Първоначално количество	2000
37	Оставащо количество	0
38	Визуализирано количество	0
39	Търгувано количество	0

### 6.13.2 Цена на допълнителен лимит (Поле 25)

#### Пример 131

Място на търговия М предлага функционалност по време на закрития аукцион, където лимитирана поръчка може да бъде въведена с лимитирана цена, която е максималната цена за покупка или минималната цена за продажба и възможността за допълнителна лимитирана цена, която представлява минималната цена за покупка или максималната цена за продажба. На място на търговия М, този тип поръчка се третира като активен без значение дали цената на ценната книга е извън минималните и максималните цени. Поръчка за покупка е подадена до място на търговия М с максимална цена за покупка от 100 EUR и допълнителна минимална лимитирана цена за покупка от 95 EUR.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	поръчка от типа "strike match"	Съгласно собствената спецификация на местата.
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	

<sup>40</sup> Следва да остане празно съгласно раздел 6.5.

Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	100	
25	Цена на допълнителен лимит	95	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
33	Статус на поръчката	ACTI	Поръчката е активна за закрит аукцион, но ще бъде изпълнена единствено, ако единната цена е в диапазона 95-100 EUR.

### 6.13.3 Класификация на лимитирана поръчка „айсберг“

#### Пример 132

На 7 март 2018 г. в 10:10:32.652758 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник X подава лимитирана поръчка за покупка „айсберг“ за изпълнение до място на търговия М. Поръчката е за покупка на 150 акции при 100,00 EUR. Поръчката „айсберг“ е определена, така че количество от 50 акции е показано в регистъра с поръчки, а 100 акции остават скрити за участниците на пазара (събитие 1).

Четиринадесет секунди след своето въвеждане в регистъра с поръчки на място на търговия М, поръчката „айсберг“ е изпълнена за своето пълно показано количество (50 акции) (събитие 2).

След частичното изпълнение на поръчката „айсберг“, нейното показано количество незабавно се попълва. В този случай, за място на търговия М, 3 микросекунди са добавени за отразяване на малка латентност в системите на мястото на търговия (събитие 3).

Събитие 1: поръчката влиза в регистъра с поръчките

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	

Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	2	Съгласно собствената класификация на място на търговия М
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	100.00	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	150	
37	Останалото количество, включително скрито	150	
38	Визуализирано количество	50	

**Събитие 2:** поръчката „айсберг“ е изпълнена за своето цяло показано количество

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:46.652785 ч.	Сделката се случва 14 секунди след нейното влизане в регистъра с поръчки
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	<i>Без промяна.</i>
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			

21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	PARF	Нареждането е частично попълнено
<b>Раздел И - Цени</b>			
28	Цена на сделката	100.00	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	150	<i>Без промяна</i>
37	Останалото количество, включително скрито	100	
38	Визуализирано количество	0	Попълването на показаното количество следва да бъде отразено на следващото събитие
39	Търгувано количество	50	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	ABC123456	

**Събитие 3:** показаното количество на поръчката „айсберг“ е попълнено

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:46.652788 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:46.652788 ч.	Когато е попълнена, поръчката „айсберг“ получава ново удостоверение за време за приоритет (т.е., дата и време на събитието за попълване).
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна,	REMA	Заменено от пазарни операции (автоматично).

	отхвърляне, частично или пълно изпълнение		
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	АСТІ	
36	Първоначално количество	150	<i>Без промяна</i>
37	Останалото количество, включително скрито	100	<i>Без промяна</i>
38	Визуализирано количество	50	

#### 6.13.4 Пазарно обвързани поръчки<sup>41</sup>

##### Пример 133

На 7 март 2018 г. в 10:10:32.652785 ч. (координирано универсално време), инвестиционният посредник подава пазарно обвързана поръчка за покупка за изпълнение до място на търговия М. При подаване на поръчката, търговецът посочва, че:

- Количество е равно на 150 без скрито количество;
- Пазарно обвързани поръчки за най-доброто предложение на мястото на търговия;
- Поръчката е определена да бъде обвързана с цена „купува“ до 100,10 EUR (т.е. ако цена „купува“ е по-висока от 100,10 EUR, то пазарно обвързаната поръчка остава при лимита 100,10 EUR).

Място на търговия М обработва пазарно обвързаната поръчка по следния начин:

Поръчката се подрежда с най-нисък приоритет;

Поръчката обвързва цената на най-добрата оферта със закъснение от 50мс<sup>42</sup>.

<sup>41</sup> За целите на този пример, пазарно обвързана поръчка е лимитрана поръчка за покупка или продажба на определено количество ценни книжа по посочена цена, определена за отчитане на ценови праг на регистъра с поръчки на място на търговия.

<sup>42</sup> Това закъснение е техническа необходимост, която е специфична за всяко място на търговия, което предлага типа пазарно обвързана поръчка (тази информация обикновено не се оповестява публично).

Състояние на регистъра с поръчки<sup>43</sup> преди поръчката да бъде подадена до място на търговия М

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	99.99	100.03	100
100	99.98	100.05	100
100	99.95	100.08	100
100	99.90	100.10	100
100	99.80	100.15	100
100	99.75	100.20	100

Събитие 1: поръчката влиза в регистъра с поръчките на място на търговия М

Състояние на регистъра с поръчки на място на търговия М при въвеждане на поръчката

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
250	99.99	100.03	100
100	99.98	100.05	100
100	99.95	100.08	100
100	99.90	100.10	100
100	99.80	100.15	100
100	99.75	100.20	100

В контекста на регистъра с поръчки на място на търговия М, подадената пазарно обвързана поръчка автоматично се присъединява към другите поръчки при най-добрата цена „купува“ (първоначална лимитирана цена от 99,99 EUR).

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	

<sup>43</sup> За всяка таблица, представена по-долу, двете леви колони („Купува“) показват поръчките за покупка на акции, които вече съществуват в регистрите с поръчки, а двете десни колони („Продава“) показват поръчките за продажба на акции, които вече съществуват в регистрите с поръчки.



Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	Пазарно обвързаната поръчка се подрежда с най-нисък приоритет; Все пак, удостоверението за време за приоритет следва да се попълни за определяне на приоритета между различните пазарно обвързани поръчки.
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	P	Съгласно собствената класификация на място на търговия M
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	Пазарно обвързаната поръчка е лимитирана поръчка с лимитирана цена, която се променя автоматично
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	99.99	
27	Цена на пазарно обвързан лимит	100.10	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	150	
37	Останалото количество, включително скрито	150	
38	Визуализирано количество	150	Липса скрито количество

**Събитие 2:** лимитираната цена на пазарно обвързана поръчка се променя след въвеждането на нова поръчка в регистъра с поръчки

В 10:10:45.685975 ч. (координирано универсално време), дневна поръчка за покупка на 200 акции при 100,00 EUR постъпва в регистъра с поръчки. Тази поръчка не се търгува и остава видима в регистъра с поръчки. Следователно, 50 милисекунди по-късно, лимитираната цена на пазарно обвързана поръчка се изравнява с последната въведена лимитирана цена на поръчка за покупка.

Състояние на регистъра с поръчките на място на търговия М

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
350	100.00	100.03	100
100	99.99	100.05	100
100	99.98	100.08	100
100	99.95	100.10	100
100	99.90	100.15	100
100	99.80	100.20	100
100	99.75		

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:45.735975 ч.	Поръчката се изравнява с новата въведена поръчка след 50 милисекунди забавяне
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:32.735975 ч.	Непроменени.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	REMA	Заменено от пазарни операции. Лимитираната цена на пазарно обвързана поръчка е автоматично променена от системата на мястото на търговия
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	100.00	Лимитираната цена се нарежда с новата най-добра оферта
27	Цена на пазарно обвързан лимит	100.10	Непроменени

**Събитие 3:** нова лимитирана поръчка за покупка постъпва в регистъра с поръчки, търгува се до 100,15 EUR и не е изцяло изпълнена

В 10:10:59.256789 ч. (координирано универсално време), дневна лимитирана поръчка е въведена за покупка на 600 акции при 100,15 EUR. Тази поръчка търгува 100 акции съответно при 100,03 EUR, 100,05 EUR, 100,08 EUR, 100,10 EUR и 100,15 EUR. Останалият размер (100) остава в регистъра с поръчките. 50 милисекунди след последното изпълнение, лимитираната цена на пазарно обвързаната поръчка е променена от пазарните операции от 100,00 EUR на 100,10 EUR: лимитираната цена на пазарно обвързаната поръчка не може да бъде определена по-високо, тъй като нейната лимитирана цена има „таван“ 100,10 EUR, определен от търговеца.

Състояние на регистъра с поръчките на място на търговия М

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	100.15	100.20	100
150	100.10		
200	100.00		

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:10:59.306789 ч.	50 милисекунди след последното изпълнение
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:10:32.652785 ч.	<i>Непроменени</i>
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	REMA	Заменено от пазарни операции. Лимитираната цена на пазарно обвързана поръчка е автоматично променена от системата на мястото на търговия М.

Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	100.10	Лимитираната цена има максимален таван от 100.10 (както е посочено в Поле 27)
27	Цена на пазарно обвързан лимит	100.10	Непроменени

### 6.13.5 Класификация на стоп поръчка

#### Пример 134

На 7 март 2018 г., в 10:05:32.652785 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник подава стоп поръчка за покупка за 150 акции за финансовия инструмент на място на търговия М. Поръчката е определена да бъде активирана, когато акцията се търгува при 100,02 EUR или повече. При активиране, поръчката става:

- при вариант А: пазарна поръчка (без лимитирана цена) и;
- при вариант Б: лимитирана поръчка (с лимитирана цена в размер на 101,00 EUR).

Периодът на валидност на поръчката е „валидна до отмяна“, което означава, че поръчката ще остане в регистъра с поръчки докато бъде активирана или отменена.

Събитие 1: поръчката влиза в регистъра с поръчките на място на търговия М

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:05:32.652785 ч.	
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:05:32.652785 ч.	Тъй като поръчката тъкмо е попаднала в регистъра с поръчки, нейното удостоверение за време за приоритет е равно на датата и времето при влизане. Удостоверението за време за приоритет на стоп поръчка трябва да бъде увеличено в сравнение с другите стоп поръчки

Раздел Е - Идентификационен код на нареждането			
20	Код за идентифициране на поръчка	123456789ABC	
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	4 при <u>Вариант А</u> и 5 при <u>Вариант Б</u>	Съгласно собствената класификация на мястото на търговия
23	Класификация на типа на нареждането	STOP	
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	[Празно] при <u>Вариант А</u> и 101.00 при <u>Вариант Б</u>	
26	Стоп цена	100.02	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
33	Статус на поръчката	INAC	
36	Първоначално количество	150	

Събитие 2: пазарен участник купува 20 акции по 100,02 EUR на място на търговия М, като следователно задейства стоп поръчка

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:05:55.652785 ч.	Активиращото събитие се случва 23 секунди след получаване на стоп поръчка от мястото на търговия.
Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията			
10	Период на валидност	IOCV	„Незабавно-или-отмяна“

Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	TRIG	Активирани
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	4 при Вариант А 5 при Вариант Б	Когато е активиран, типът нареждане остава идентичен; все пак, неговата класификация (поле 23) се променя
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	Щом бъде активирана, стоп поръчката следва да бъде класифицирана като лимитирана поръчка.
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	[Празно] при <u>Вариант А</u> както и 101.00 при <u>Вариант Б</u>	
26	Стой цена	100.02	Стой цената остава непопълнена въпреки че не трябва да бъде взета предвид щом статусът се промени на „АСТІ“ в поле 33
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
33	Статус на поръчката	АСТІ	Когато стоп поръчката бъде пусната, нейният статус става „активна“.

### 6.13.6 Насочени поръчки

#### Пример 135

На 7 март 2018 г. в 10:05:32 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник X подава лимитирана поръчка за покупка за изпълнение до място на търговия M. Поръчката е за покупка на 150 акции при 100,02 EUR. При подаване на поръчката до място на търговия M, търговецът посочва, че поръчката следва да бъде пренасочена към друго място на търговия (място на търговия N), ако тя не може да бъде изпълнена на място на търговия M, независимо изцяло (вариант А) или частично (вариант Б). При всеки вариант, нетъргуваният обем (съгласно вариант А) или оставащият обем (съгласно вариант Б) на поръчката се насочват до място на търговия N.

Насочената поръчка е частично изпълнена на място на търговия N. Тази сделка на място на търговия N следва да бъде записана в системите на място на търговия M.

И при двата варианта, търговецът също посочва, че в случай че поръчката не може да бъде изпълнена изцяло на място на търговия N, поръчката следва да се върне на място на търговия M. Следователно, след като бъде частично изпълнена на място на търговия N, поръчката е повторно активирана в регистъра с поръчки на място на търговия M.

За целите на насочване на поръчката от място на търговия М до място на търговия N, услуга за Пряк електронен достъп (ПЕД) е осигурена от инвестиционен посредник Z, който извършва действия като член на място на търговия N.

Състояние на регистрите с поръчки<sup>44</sup> преди поръчката да бъде подадена до място на търговия М

**Състояние на регистъра с поръчки на място на търговия М, където поръчката първоначално е подадена**

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	99.99	100.03	100
100	99.98	100.05	100
100	99.95	100.08	100
100	99.90	100.10	100
100	99.80	100.15	100

**Състояние на регистъра с поръчки на място на търговия N, където поръчката ще бъде насочена**

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	99.99	100.01	100
100	99.98	100.03	100
100	99.95	100.04	100
100	99.90	100.05	100
100	99.80	100.08	100

Събитие 1: поръчката влиза в регистъра с поръчките на място на търговия М

Състояние на регистъра с поръчки на място на търговия М при въвеждане на поръчката

КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
150	100.02	100.03	100
100	99.99	100.05	100
100	99.98	100.08	100
100	99.95	100.10	100
100	99.90	100.15	100
100	99.80		

В контекста на регистъра с поръчки на място на търговия М, подадената лимитирана поръчка не може да бъде изпълнена (тя не съответства на насрещната страна изобщо).

Поръчката следва да бъде отразена в регистъра на място на търговия М като нова поръчка (прочетете раздел 6.13.1 В допълнение, стратегията по пренасочване (поле 47) следва да бъде

<sup>44</sup> За всяка таблица, представена по-долу, двете леви колони („Купува“) показват поръчките за покупка на акции, които вече съществуват в регистрите с поръчки, а двете десни колони („Продава“) показват поръчките за продажба на акции, които вече съществуват в регистрите с поръчки. За целта на настоящите насоки, всяка лимитирана поръчка отразява само една поръчка.

попълнена като буквено-цифров текст (до 50 знака) съгласно спецификацията на място на търговия М.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
47	Стратегия по пренасочване	ROUTING_TO_TV_N_ONLY	Буквено-цифров текст (до 50 знака) съгласно спецификацията на място на търговия М

Събитие 2: поръчката е насочена към място на търговия N

При вариант А

Тъй като поръчката не може да бъде изпълнена при 100,02 EUR на място на търговия М при нейното вписване в регистъра с поръчки, тя се насочва към място на търговия N съгласно инструкцията, определена от търговеца. В резултат, поръчката се премахва от регистъра с поръчки на място на търговия М. Все пак, ако поръчката не може изцяло да бъде изпълнена на място на търговия N, неизтъргуваното количество се връща в регистъра с поръчки на място на търговия М съгласно първоначалните инструкции на търговеца.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:05:32.652788 ч.	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	CHMO	„Промяна на статуса поради пазарни операции“
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	ROUT	Поръчката е насочена към място на търговия N.



36	Първоначално количество	150	<i>Без промяна</i>
37	Останалото количество, включително скрито	150	Това поле също съответства на количеството, което се пренасочва към друго място на търговия
38	Визуализирано количество	0	Въпреки че е насочена към друго място на търговия, никакво количество не е показано за поръчката на място на търговия М.

При вариант Б

Поръчката беше частично изпълнена на място на търговия М (покупка на 25 акции) преди да бъде насочена към място на търговия N с останалото количество (125 акции). Това пренасочване на поръчка след частично събитие е отразено в регистрите на място на търговия М в следните полета.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	ROUT	Поръчката е насочена към място на търговия N.
36	Първоначално количество	150	<i>Без промяна</i>
37	Останалото количество, включително скрито	125	То отразява количеството, което остава да бъде търгувано след покупката на 25 акции на място на търговия М
38	Визуализирано количество	0	Въпреки че е насочена към друго място на търговия, никакво количество не е показано за поръчката на място на търговия М.
39	Търгувано количество		Покупка на 25 акции е регистрирана при предишно събитие

Следната таблица показва как входящата поръчка, пренасочена от място на търговия М, е отразена в регистъра на място на търговия N.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	LEI на инвестиционен посредник Z, който е член на място на търговия N и предава поръчката от името на място на търговия M	
2	Пряк електронен достъп (ПЕД)	true	
3	Код за идентифициране на клиент	LEI на място на търговия M	В този случай, място на търговия M е клиента на члена на място на търговия N (инвестиционен посредник Z). Ако съществува друг посредник между тях, това поле не следва да се попълва с LEI на място на търговия M.
<b>Раздел Б - Качеството, в което лицето търгува и осигуряване на ликвидност</b>			
7	Качеството, в което лицето търгува	АОТС	Инвестиционен посредник Z извършва действия от името на място на търговия M.
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>			
16	Код на сегмент MIC	Код на сегмент MIC на място на търговия N	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането	IOC_ORDER	Съгласно собствената класификация на място на търговия N
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	150 при Вариант А както и 125 при Вариант Б	

37	Останалото количество, включително скрито	150 при Вариант А и 125 при Вариант Б	
----	---	---	--

**Събитие 3:** при нейното постъпване в регистъра с поръчките на място на търговия N, поръчката е частично изпълнена

Поръчката следва да бъде отразена в регистъра на място на търговия N като частично изпълнена поръчка (прочетете раздел 6.13.1.4). В допълнение, поле 48 трябва да бъде попълнено както следва:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	DEF54321	

**При вариант А**

При вписването на поръчката в регистъра с поръчки на място на търговия N, 100 акции са закупени на място на търговия N. Тази покупка на място на търговия N трябва да бъде отразена в регистрите на място на търговия M във връзка с първоначалната поръчка.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:05:32.662788 ч.	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	PARF	Нареждането е частично попълнено

Раздел И - Цени			
28	Цена на сделката	100.01	Поръчката беше частично изпълнена при 100.01 на място на търговия N
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
33	Статус на поръчката	ROUT	Без промяна
36	Първоначално количество	150	Без промяна
37	Останалото количество, включително скрито	50	
38	Визуализирано количество	0	Като поръчката все още е със статус „насочена“.
39	Търгувано количество	100	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия		Това поле следва да бъде празно, защото сделката не е изпълнена на място на търговия M

#### При вариант Б

Преди да бъде пренасочена към място на търговия N, поръчката е частично изпълнена на място на търговия M (покупка на 25 акции). Следователно, поръчката, насочена към място на търговия N, е свързана само с 125 акции. При постъпване в регистъра с поръчки на място на търговия N, поръчката е частично изпълнена (покупка на 100 акции).

Търговията на място на търговия N следва да бъде отразена в регистрите на място на търговия M, както е представено в предходната таблица с изключение на следните полета.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	PARF	Нареждането е частично попълнено
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
33	Статус на поръчката	ROUT	
36	Първоначално количество	150	Първоначалното количество е непроменено при Вариант Б

37	Останалото количество, включително скрито	25	25 акции вече са закупени на място на търговия М преди тя да бъде насочена.
38	Визуализирано количество	0	
39	Търгувано количество	100	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия		Това поле следва да бъде празно, защото сделката не е изпълнена на място на търговия М

**Събитие 4:** насочената поръчка е активирана повторно в регистъра с поръчки на място на търговия М

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:05:32.662791 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:05:32.662791 ч.	Поръчката е изгубила своето удостоверение за време за приоритет, когато е била насочен акъм място на търговия N. Удостоверението за време за приоритет е равно на времето, за което тя постъпва обратно в регистъра с поръчки на място на търговия М.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	СНМО	„Промяна на статуса поради пазарни операции“
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	100.02	<i>Без промяна</i>
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
33	Статус на поръчката	АСТІ	При това събитие, поръчката става активна в регистъра с поръчки на място на търговия М.

36	Първоначално количество	150	<i>Без промяна</i>
37	Останалото количество, включително скрито	50 при Вариант А и 25 при Вариант Б	
38	Визуализирано количество	50 при Вариант А и 25 при Вариант Б	

### 6.13.7 Класификация на поръчки, подадени съгласно стратегия (поле 46)

#### 6.13.7.1 Предвидена функционалност

##### Пример 136

##### Поръчка на инвестиционен посредник X

Инвестиционен посредник X желае да въведе поръчка за опция юли (упражняване 225) до място на търговия М. На 10 март 2018 г. в 10:07:16.523871 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник X въвежда окончателна поръчка с изтичане юли за покупка на 200 кол опции с упражняване 225 и цена от 13 EUR. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия М за кол опции през юли е 256718, а ISIN е XX1234567890.

##### Инвестиция Поръчка на дружество Y

Различен инвестиционен посредник (дружество Y) желае да въведе поръчка за опция август (упражняване 225) до място на търговия М. На 7 март 2018 г. в 10:09:38.981242 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник Y въвежда окончателна поръчка с изтичане август за продажба на 100 кол опции с упражняване 225 и цена от 15,5 EUR. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия М за кол опции през август е 256735, а ISIN е XXABCDEFGHIIJ.

##### Имплицитна поръчка - календарен спред за опции

Функционалността на имплицитната поръчка на място на търговия М означава, че двете окончателни поръчки генерират имплицитна поръчка в стратегията за календарен спред за опции. Тази имплицитна поръчка представлява продажба 100 юли-август FCAL при цена 2,5 EUR. Тя се разпространява на пазара чрез подаване на информация. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия М за „FCAL юли-август 225“ е 256786.

##### Поръчка на инвестиционен посредник Z

Инвестиционен посредник Z с LEI: KLMNOPQRST1234567890, желае да въведе поръчка в същия календарен спред за опции. На 7 март 2018 г. в 10:09:56.684251 ч. (координираното универсално време), инвестиционен посредник Z въвежда поръчка за календарен спред за покупка на 100 „юли-август FCAL 225“ при цена 2,5 EUR. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия М за „FCAL юли-август 225“ е 256786. Изпълнява незабавно срещу споменатата по-горе имплицитна поръчка.

**Събитие 1:** Поръчката на инвестиционен посредник X влиза в регистъра с поръчките

Състояние на регистъра с поръчки<sup>45</sup> при въвеждане на поръчката (нова поръчка, маркирана в червено)

<b>Юли търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
<b>200</b>	<b>13.00</b>	13.25	100
100	11.25	13.30	100
100	11.20	13.35	100
100	11.15		

<b>Август търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	15.25	16.50	100
100	15.20	16.55	100
100	15.15	16.65	100

<b>FCAL юли-август 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	2.00	5.25	100

За търга през юли 225: Окончателната поръчка от инвестиционен посредник X е за покупка на 200 кол опции за юли с упражняване от 225 при цена 13 EUR. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия M за опции „Юли Кол 225“ е 256718. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

<sup>45</sup> За всяка таблица, представена по-долу, двете леви колони („Купува“) показват поръчките за покупка, които вече съществуват в регистрите с поръчки, а двете десни колони („Продава“) показват поръчките за продажба, които вече съществуват в регистрите с поръчки. За целите на настоящите насоки, съществува само една поръчка на всяко ценово равнище.

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	12345678901234567890	
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:07:16.523871 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:07:16.523871 ч.	Тъй като поръчката тъкмо е попаднала в регистъра с поръчки, нейното удостоверение за време за приоритет е равно на датата и времето при влизане
15	Пореден номер	3758945	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
17	Код за регистриране на нареждане	256718	
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890	
20	Код за идентифициране на поръчка	Xj26F458s	Уникален код на поръчка на мястото на търговия.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	Дори ако поръчката е изпълнена при нейното регистриране в регистъра с поръчки, първото събитие за отчитане е „Нова поръчка“
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането	Лимит	Съгласно собствената класификация на мястото на търговия.
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	13	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	



33	Статус на поръчката	АСТІ	
36	Първоначално количество	200	
37	Останалото количество, включително скрито	200	
38	Визуализирано количество	200	
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка		Празно като все още неизпълнена.

Събитие 2: Поръчката на инвестиционен посредник Y влиза в регистъра с поръчките

Състояние на регистъра с поръчки<sup>46</sup> при въвеждане на поръчката (нова поръчка, маркирана в червено)(поръчка

<b>Юли търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
200	13.00	13.25	100
100	11.25	13.30	100
100	11.20	13.35	100
100	11.15		

<b>Август търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	15.25	15.50	100
100	15.20	16.50	100
100	15.15	16.55	100
		16.65	100

<sup>46</sup> За всяка таблица, представена по-долу, двете леви колони („Купува“) показват поръчките за покупка, които вече съществуват в регистрите с поръчки, а двете десни колони („Продава“) показват поръчките за продажба, които вече съществуват в регистрите с поръчки. За целите на настоящите насоки съществува само една поръчка на всяко ценово равнище.

<b>FCAL юли-август 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	2.00	5.25	100

За търга през август 225: Окончателната поръчка от инвестиционен посредник Y е за продажба на 100 кол опции за август с упражняване от 225 при цена 15,5 EUR. Кодът на регистъра с поръчки за място на търговия M за опции „Август Кол 225“ е 256735. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	ABCDEFGHIJKLMNQRST	
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:38.981242 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:09:38.981242 ч.	Тъй като поръчката тъкмо е попаднала в регистъра с поръчки, нейното удостоверение за време за приоритет е равно на датата и времето при влизане
15	Пореден номер	3758946	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
17	Код за регистриране на нареждане	256735	Код за регистриране на нареждане на мястото на търговия.
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XXABCDEFGHIJ	
20	Код за идентифициране на поръчка	Xj26F459n	Уникален код на поръчка на мястото на търговия M.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	Дори ако поръчката е изпълнена при нейното регистриране в регистъра с

			поръчки, първото събитие за отчитане е „Нова поръчка“
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането	Лимит	Съгласно собствената класификация на мястото на търговия М.
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	<b>15.5</b>	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	100	
37	Останалото количество, включително скрито	100	
38	Визуализирано количество	100	
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка		Празно като все още неизпълнена.

### Събитие 3: Имплицитна поръчка, въведена в регистъра с поръчки

Състояние на регистъра с поръчки<sup>47</sup> при въвеждане на имплицитна поръчка (нова поръчка, маркирана в червено)

<b>FCAL юли-август 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	2.00	<b>2.50</b>	<b>100</b>
		5.25	100

<sup>47</sup> За целите на настоящите насоки съществува само една поръчка на всяко ценово равнище.

<b>Юли търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
200	13.00	13.25	100
100	11.25	13.30	100
100	11.20	13.35	100
100	11.15		

<b>Август търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	15.25	15.50	100
100	15.20	16.50	100
100	15.15	16.55	100
		16.65	100

За регистър с поръчки „FCAL юли-август 225“: ИмPLICITна поръчка е генерирана от място на търговия М от две окончателни поръчки, въведени от инвестиционни посредници Х и Y във връзка с кол опции юли и август. ИмPLICITната поръчка представлява поръчка за продажба на „100 юли-август FCAL“ при цена 2,5 EUR. Кодът на регистъра с поръчки на място на търговия М за регистъра с поръчки FCAL юли-август 225 е 256786. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички. Полета 1,2,3,4,5,6,7 и 8 винаги ще бъдат празни, защото това е имPLICITна поръчка, която е генерирана от място на търговия, а не от член/участник.

<b>Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване</b>			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:38.981242 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:09:38.981242 ч.	Тъй като поръчката тъкмо е попаднала в регистъра с поръчки, нейното удостоверение за време за приоритет е равно на датата и времето при влизане
15	Пореден номер	3758947	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
17	Код за регистриране на нареждане	256786	Код за регистриране на нареждане на мястото на търговия М.
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Тъй като стратегиите не са финансови инструменти, те нямат ISIN, затова са включени ISIN, които съставляват стратегията.

20	Код за идентифициране на поръчка	Xj26F460g	Уникален код на поръчка на мястото на търговия М.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	Дори ако поръчката е изпълнена при нейното регистриране в регистъра с поръчки, първото събитие за отчитане е „Нова поръчка“
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането	Имплицитно	Съгласно собствената класификация на мястото на търговия.
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	2.5	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
33	Статус на поръчката	IMPL	За посочване, че това е имплицитна поръчка изцяло.
36	Първоначално количество	100	
37	Останалото количество, включително скрито	100	
38	Визуализирано количество	100	
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка		Празно като все още неизпълнена.

**Събитие 4:** Поръчката на инвестиционен посредник Z влиза в регистъра с поръчките

Състояние на регистрите с поръчки (новата поръчка е маркирана в червено)

<b>Юли търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
200	13.00	13.25	100
100	11.25	13.30	100
100	11.20	13.35	100
100	11.15		

<b>Август търг 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	15.25	15.50	100
100	15.20	16.50	100
100	15.15	16.55	100
		16.65	

<b>FCAL юли-август 225</b>			
<b>КУПУВА</b>		<b>ПРОДАВА</b>	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	2.50	2.50	100
100	2.00	5.25	100

За FCAL юли-август 225: Поръчката за календарен спред от инвестиционен посредник Z е за покупката на 100 юли-август FCAL при цена 2,5 EUR. Кодът на регистъра с поръчки на място на търговия M за регистъра с поръчки FCAL юли-август 225 е 256786. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	KLMNOPQRST1234567890	
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.	Тъй като поръчката тъкмо е попаднала в регистъра с поръчки, нейното удостоверение за време за приоритет е равно на датата и времето при влизане
15	Пореден номер	3759523	

Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
17	Код за регистриране на нареждане	256786	Код за регистриране на нареждане на мястото на търговия М.
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Тъй като стратегиите не са финансови инструменти, те нямат ISIN, затова са включени ISIN, които съставляват стратегията.
20	Код за идентифициране на поръчка	Xj26H127c	Уникален код на поръчка на мястото на търговия М.
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO	Дори ако поръчката е изпълнена при нейното регистриране в регистъра с поръчки, първото събитие за отчитане е „Нова поръчка“
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	Лимит	Съгласно собствената класификация на мястото на търговия
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	2.5	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
33	Статус на поръчката	ACTI	
36	Първоначално количество	100	
37	Останалото количество, включително скрито	100	
38	Визуализирано количество	100	
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка		Празно като все още неизпълнена.

**Събитие 5:** Изпълнение в регистъра с поръчки за календарен спред и промени в поръчките в окончателните договори.

Състояние на регистъра с поръчки<sup>48</sup> в момента на изпълнение

<sup>48</sup> Поръчките, отбелязани в оранжево, се изпълняват и това причинява актуализиране на поръчка за поръчката, маркирана в синьо и пълно изпълнение на поръчката, маркирана в пурпурно.

<b>Юли търг 225</b>			
КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	13.00	13.00	100
100	11.25	13.25	100
100	11.20	13.30	100
100	11.15	13.35	100

<b>Август търг 225</b>			
КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	15.50	15.50	100
100	15.25	16.50	100
100	15.20	16.55	100
100	15.15	16.65	100

<b>FCAL юли-август 225</b>			
КУПУВА		ПРОДАВА	
Количество	Лимитирана цена	Лимитирана цена	Количество
100	2.50	2.50	100
100	2.00	5.25	100

Поръчката за календарен спред от инвестиционен посредник Z за покупката на 100 юли-август FCAL при цена 2,5 EUR е изпълнена в пълен размер. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	KLMNOPQRST1234567890	Без промяна
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.	Време на това събитие.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет		Празно, тъй като поръчката е търгувана в пълен размер и следователно вече не е активна.
15	Пореден номер	3759539	Поредният номер на това съобщение.



Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
17	Код за регистриране на нареждане	256786	Без промяна
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Без промяна
20	Код за идентифициране на нареждане	Xj26H127c	Без промяна
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	FILL	Поръчка, търгувана в пълен размер.
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	Лимит	Без промяна
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	Без промяна
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	2.5	Без промяна
28	Цена на сделката	2.5	Цена на изпълнение.
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	Без промяна
33	Статус на поръчката		Празно, защото поръчката е търгувана в пълен размер.
36	Първоначално количество	100	Без промяна
37	Останалото количество, включително скрито	0	Останалото количество сега е 0.
38	Визуализирано количество	0	Показаното количество е 0, тъй като се е търгувало изцяло.
39	Търгувано количество	100	Да отразява търгуваното количество.
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка		Празно тъй като тази поръчка беше въведена директно в регистъра с поръчки за календарен спред.
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	TEKXC456GH20	Попълнено за осигуряване на уникален идентификационен код за сделка за изпълнената сделка.

За поръчка за продажба с регистъра с поръчки за календарен спред: Имплицитната поръчка за продажба на 100 юли-август FCAL при цена 2,5 EUR е изпълнена в пълен размер. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички. Полета 1,2,3,4,5,6,7 и

8 винаги ще бъдат празни, защото това е имплицитна поръчка, която е генерирана от място на търговия, а не от член/участник.

N		Поле		Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>					
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.			Време на това събитие.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>					
13	Удостоверение за време за приоритет				Празно, тъй като поръчката е търгувана в пълен размер и следователно вече не е активна.
15	Пореден номер	3759540			Поредният номер на това съобщение.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>					
17	Код за регистриране на нареждане	256786			Без промяна
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ			Без промяна
20	Код за идентифициране на нареждане	Xj26F460g			Без промяна
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>					
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	FILL			Поръчка, търгувана в пълен размер.
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>					
22	Тип на нареждането	Имплицитно			Без промяна
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO			Без промяна
<b>Раздел И - Цени</b>					
24	Лимитирана цена	2.5			Без промяна
28	Цена на сделката	2.5			Цена на изпълнение.
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>					
32	Показател за покупка-продажба	SELL			Без промяна
33	Статус на поръчката				Празно, защото поръчката е търгувана в пълен размер.
36	Първоначално количество	100			Без промяна

37	Останалото количество, включително скрито	0	Останалото количество сега е 0.
38	Визуализирано количество	0	Показаното количество е 0, тъй като се е търгувало изцяло.
39	Търгувано количество	100	Да отразява търгуваното количество.
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка	Xj26K983c	Попълнено за свързване на относимите окончателни поръчки, които са част от изпълнението.
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	TEKXC456GH20	Попълнено за осигуряване на уникален идентификационен код за сделка за изпълнената сделка.

За търга през юли 225: Окончателната поръчка от инвестиционен посредник X за покупка на 200 юли кол опции с упражняване от 225 при цена 13 EUR е частично изпълнена за 100. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	12345678901234567890	Без промяна
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	07.03.2018 г., 10:07:16.523871 ч.	Час на въвеждане на окончателната поръчка
15	Пореден номер	3759541	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
17	Код за регистриране на нареждане	256718	Без промяна
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX1234567890	Без промяна
20	Код за идентифициране на нареждане	Xj26F458s	Без промяна

Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	PARF	
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	Лимит	Без промяна
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	Без промяна
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	13	Без промяна
28	Цена на сделката	13	Цена на изпълнение.
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	Без промяна
33	Статус на поръчката	ACTI	Без промяна
36	Първоначално количество	200	Без промяна
37	Останалото количество, включително скрито	100	.
38	Визуализирано количество	100	
39	Търгувано количество	100	За отразяване на търгуваното количество за това събитие.
46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка	Xj26K983c	Попълнено за свързване на относимите окончателни поръчки с имплицитната поръчка, която беше част от изпълнението.
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	TEKXC456GH18	Попълнено за осигуряване на уникален идентификационен код за сделка за изпълнената сделка. Това е различен идентификационен код на сделка от този в регистъра с поръчки за календарен спред.

За търга през август 225: Окончателната поръчка от инвестиционен посредник Y за продажба на 100 август кол опции с упражняване от 225 при цена 15,5 EUR е изпълнена изцяло. Таблицата по-долу посочва основните полета, които да бъдат попълнени, но не всички:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
---	------	--	-----------------------------

Раздел А - Идентификация на съответните страни			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	ABCDEFGHIJKLMNQRST	Без промяна
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	07.03.2018 г., 10:09:56.684251 ч.	
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет		Празно, тъй като поръчката е търгувана в пълен размер и следователно вече не е активна.
15	Пореден номер	3759542	
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
17	Код за регистриране на нареждане	256735	Без промяна
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XXABCDEFGHIJ	Без промяна
20	Код за идентифициране на нареждане	Xj26F459n	Без промяна
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	FILL	Поръчка, търгувана в пълен размер.
Раздел З — Тип на нареждането			
22	Тип на нареждането	Лимит	Без промяна
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO	Без промяна
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	15.5	Без промяна
28	Цена на сделката	15.5	Цена на изпълнение.
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	Без промяна
33	Статус на поръчката		Празно, защото поръчката е търгувана в пълен размер.
36	Първоначално количество	100	Без промяна
37	Останалото количество, включително скрито	0	Останалото количество сега е 0.
38	Визуализирано количество	0	Показаното количество е 0, тъй като се е търгувало изцяло.
39	Търгувано количество	100	Да отразява търгуваното количество.

46	Идентифициране на свързана със стратегия поръчка	Xj26K983c	Попълнено за свързване на относимите окончателни поръчки с имплицитната поръчка, която беше част от изпълнението.
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	TEKXC456GH19	Попълнено за осигуряване на уникален идентификационен код за сделка за изпълнената сделка. Това е различен идентификационен код на сделка от този в регистъра с поръчки за календарен спред.

#### 6.13.7.2 Предвидена функционалност

Същата методология следва да бъде използвана при имплицитни поръчки.

#### 6.13.8 Промяна на приоритет

Описани са следните ситуации:

- удостоверения за време за приоритет за система за приоритетна търговия, свързана с видимата цена/време;
- удостоверения за време за приоритет и размер на приоритетната поръчка за система за приоритетна търговия, свързана с обем/време;
- удостоверение за време за приоритет и размер на приоритетната поръчка за пропорционална основна софтуерна система за търговия.

##### 6.13.8.1 Приоритет за време цена-видимост

###### Пример 137

Инвестиционен посредник X въвежда нова поръчка за покупка „валидна до отмяна“ за 50 акции при лимит на цената от 10 000 EUR на 30 юни 2018 г. в 11:20:30.112121 ч. (координираното универсално време) (събитие 1). Момент по-късно, в 11:20:31.354454 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник Y въвежда нова, дневна поръчка за покупка за 70 акции на същото равнище на ценови лимит от 10000 EUR (събитие 2).

Поради правилото за времеви приоритет за цена поръчката за 70 акции ще бъде приета в регистъра с поръчки на място на търговия на същото ценово равнище, но зад поръчката за 50 акции. Различните приоритети ще бъдат определени от стойностите в полето удостоверение за време за приоритет.

Ако поръчката от 50 акции е променена като нейното количество бъде увеличено до 55 акции на 27 юни 2018 г. в 11:20:35.344541 ч.(координираното универсално време) тя ще загуби своя приоритет пред поръчката за 70 акции. Следователно, точното време на подобни промени на поръчки следва да бъде регистрирано в поле удостоверение за време за приоритет (събитие 3).

На това място на търговия, поръчките, валидни до отмяна са валидни за 1 година.

Събитие 1: Въвеждане на нова поръчка за покупка, валидна до отмяна за 50 акции

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час		27.06.2018 г., 11:20:30.112121 ч.
<b>Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>			
10	Период на валидност		GTCA
12	Дата и час на периода на валидност		27.06.2018 г., 23:59:59.999999 ч.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет		27.06.2018 г., 11:20:30.112121 ч.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на нареждане		123456789ABC
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение		NEWO
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането		Лимит
23	Класификация на типа на нареждането		LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена		10.000
28	Цена на сделката		
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
36	Първоначално количество		50

Събитие 2: Въвеждане на нова дневна поръчка за покупка за 70 акции

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час		27.06.2018 г., 11:20:31.354454 ч.
<b>Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>			
10	Период на валидност		DAVY
12	Дата и час на периода на валидност		27.06.2018 г., 23:59:59.999999 ч.

Раздел Д - Приоритет и пореден номер		
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 11:20:31.354454 ч.
Раздел Е - Идентифициране на нареждане		
20	Код за идентифициране на нареждане	45533344ABC
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането		
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	NEWO
Раздел З — Тип на нареждането		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
Раздел И - Цени		
24	Лимитирана цена	10.000
36	Първоначално количество	70

Събитие 3: Поръчка на 50 акции е променена

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Раздел В - Дата и час		
9	Дата и час	27.06.2018 г., 11:20:33.344541 ч.
Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията		
10	Период на валидност	GTCV
12	Дата и час на периода на валидност	27.06.2018 г., 23:59:59.999999 ч.
Раздел Д - Приоритет и пореден номер		
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 11:20:33.344541 ч.
Раздел Е - Идентификационен код на нареждането		
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането		
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	REME
Раздел З — Тип на нареждането		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
Раздел И - Цени		
24	Лимитирана цена	10.000
Раздел Й - Инструкции за нареждането		
36	Първоначално количество	55



### 6.13.8.2 Приоритет за размер и време

#### Пример 138

Инвестиционен посредник X въвежда нова поръчка за покупка за 100 акции на определено ценово равнище на 27 юни 2018 г. в 11:20:30.112121 ч. (координираното универсално време) (събитие 1).

Момент по-късно в 11:20:31.354454 ч. (координираното универсално време), инвестиционен посредник Y въвежда нова поръчка за покупка на същото ценово равнище, но с по-високо количество (325 акции) (събитие 2). На това място на търговия, поръчките за по-големи количества имат приоритет пред поръчките за по-малки количества.

Поради приоритета за размер и време поръчката за 325 акции ще бъде поставена в регистъра преди поръчката за 100 акции. Компетентният орган ще може да възстанови това като отчете първо размера на приоритета и след това удостоверението за време за приоритет на поръчките, които са – за всяка поръчка по отделно – регистрирани от мястото на търговия в полето удостоверение за време за приоритет и полето размер на приоритета, съответно. Ако поръчката за 325 акции е променена като нейното количество бъде намалено до 90 акции на 27 юни 2018 г. в 11:20:35.325891 ч. (координираното универсално време) тя ще загуби приоритет пред поръчката за 100 акции. Тази промяна на поръчка трябва да бъде регистрирана в полето удостоверение за време за приоритет и в полето размер на приоритета (събитие 3).

За описаните по-горе случаи полето удостоверение за време за приоритет и полето размер на приоритета следва да бъдат попълнени — за всяка поръчка и промяна на поръчка по отделно - както следва. За удобство единствено полета 13 и 14 са включени като най-значими полета за този пример.

Събитие 1: Въвеждане на поръчка от 100 акции

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
N	Поле	
Раздел Д - Приоритет и пореден номер		
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 11:20:30.112121 ч.
14	Размер на приоритета	100

Събитие 2: Въвеждане на поръчка от 325 акции:

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		
N	Поле	
Раздел Д - Приоритет и пореден номер		
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 11:20:31.354454 ч.
14	Размер на приоритета	325

**Събитие 3:** Промяна на поръчката с 325 акции в поръчка с 90 акции

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет		27.06.2018 г., 11:20:35.325891 ч.
14	Размер на приоритета		90

6.13.8.3 Пропорционална основна софтуерна система за търговия

Пример 139

Инвестиционен посредник X въвежда нова поръчка за покупка за 200 акции при ценови лимит 10000 EUR на 27 юни 2018 г. в 11:20:30.112121 ч. (координирано универсално време) в регистър с поръчки като се използва пропорционален алгоритъм за съответствие, където количеството на входяща поръчка е разпределено на всички оставащи поръчки пропорционално на тяхното оставащо количество.

Местата на търговия, които използват пропорционални алгоритми за съответствие, ще могат да попълнят поле 14 размер на приоритета със стойност „0“ (нула), при условие че са публикували данните на алгоритъма, които позволяват на компетентните органи да изградят отново механизма на изпълнение на поръчка. Следователно, полета 13 и 14 биват попълнени както е посочено по-долу:

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет		27.06.2018 г., 11:20:30.112121 ч.
14	Размер на приоритета		0

6.13.9 Фази на търговия

Пример 140

Място на търговия M провежда открит търг за финансов инструмент, който започва в 07:50:00.425381 ч. (координираното универсално време+1) на 27 юни 2018 г. Преди това не са налице поръчки в регистъра с поръчки. Индикативната цена на търга все още не е определена тъй като няма поръчки и индикативният обем на търга е 0 акции (събитие 1). В 07:55:21.528754 ч. (координираното универсално време+1), инвестиционен посредник X въвежда поръчка за покупка за 100 акции по 1 EUR (събитие 2).

В 07:57:46.255897 ч. (координираното универсално време+1), инвестиционен посредник Y въвежда поръчка за продажба за 50 акции на пазара. Това създава регистър с обобщени поръчки и следователно индикативна цена от 1 EUR и индикативен обем от 50 акции (събитие 3). В 07:59:52.264547 ч. (координираното универсално време+1), дружество въвежда предложение за 25 акции на пазара. Това няма въздействие върху индикативната цена, но индикативният обем нараства до 75 акции (събитие 4). В 08:00:25.149531 ч. (координирано универсално време +1), поръчките се обобщават в края на търга като двете поръчки за продажба са въведени като събития 3 и 4, които се търгуват с поръчката за покупка, въведена в събитие 2 и тогава ценната книга започва продължителна търговия (събитие 5). Фазите на търговия са показани в техния собствен отделен ред. Ред с фази на търговия следва да се поддържа всеки път, когато се променя. Индикативната цена на търга и индикативният обем на търга са показани заедно на техния собствен ред както и когато всяка от стойностите се променя.

#### Събитие 1: Отворен търг

Ред 1 съдържа следната информация като всички други полета остават празни (включително полета 50 (Индикативна цена на търга) и 51 (Индикативен обем на търга), тъй като тези полета не се изискват при показване на промяна във фазата на търговия). Единствените полета, които да бъдат запълнени, са:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:50:00.425381 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
15	Пореден номер	20056	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
16	Код на сегмент МІС	ХМІС	
17	Код за регистриране на нареждане	XYZ9876	
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000	
20	Код за идентифициране на нареждане		Празно като промяна във фазата на търговия.
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение		

**Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем**

49	Фази на търговия	Отворен търг	
----	------------------	--------------	--

Тъй като началният търг е започнал, полето индикативна цена на търга следва да бъде празно за показване, че индикативна цена на търга не е определена и индикативният обем на търга от 0 акции следва да бъде поддържан. Следователно, ред 2 следва да показва тази информация като всички други полета остават празни. Единствените полета, които да бъдат запълнени, са:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:50:00.425381 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
15	Пореден номер	20068	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
16	Код на сегмент МІС	ХМІС	
17	Код за регистриране на нареждане	XYZ9876	
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000	
20	Код за идентифициране на поръчка		Празно като промяна в индикативните цена и обем.
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като никаква цена не е определена.
51	Индикативен обем на търга	0	Липсва обем на търга.

**Събитие 2:** Въвеждане на поръчка за 100 акции

Ред 3 от данните съдържа въвеждането на новата поръчка съгласно следното (не всички полета за въвеждане на поръчки са включени):

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:55:21.528754 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 06:55:21.528754 ч.	
15	Пореден номер	20075	
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>			
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	NEWO	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена	1	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
36	Първоначално количество	100	
37	Останалото количество, включително скрито	100	
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

**Събитие 3:** Въвеждане на нова поръчка от 50 акции

Ред 4 от данните съдържа въвеждането на новата поръчка съгласно следното (не всички полета за въвеждане на поръчки са включени):

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:57:46.255897 ч.	
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 06:57:46.255897 ч.	
15	Пореден номер	20089	
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на поръчка	987654321DEF	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	NEWO	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена		Празно като пазарна поръчка без цена.
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
36	Първоначално количество	50	
37	Останалото количество, включително скрито	50	
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

Ред 5 от данните показва въздействието върху индикативната цена на търга и индикативния обем на търга на въвеждането на гореспоменатата поръчка като всички други полета остават празни. Единствените полета, които да бъдат запълнени, са:

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:57:46.255897 ч.	Без промяна.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
15	Пореден номер	20095	Поредният номер на това събитие е различен.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
16	Код на сегмент MIC	XMIC	
17	Код за регистриране на нареждане	XYZ9876	
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000	
20	Код за идентифициране на нареждане		Празно като промяна в индикативните цена и обем.
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
50	Индикативна цена на търга	1	
51	Индикативен обем на търга	50	

Събитие 4: Въвеждане на нова поръчка за 25 акции

Ред 6 от данните съдържа въвеждането на новата поръчка съгласно следното (не всички полета за въвеждане на поръчки са включени):

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:59:52.264547 ч.	Часът на въвеждане на поръчката

Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 06:59:52.264547 ч.	Същото като часът на въвеждане.
15	Пореден номер	20156	Поредният номер на това събитие е различен.
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
20	Код за идентифициране на нареждане	543216789GHI	
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	NEWO	
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена		Празно като пазарна поръчка без цена.
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
36	Първоначално количество	25	
37	Останалото количество, включително скрито	25	
Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.



Ред 7 от данните показва въздействието върху индикативната цена на търга и индикативния обем на търга като всички други полета остават празни. Единствените полета, които да бъдат запълнени, са:

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 06:59:52.264547 ч.	Без промяна.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
15	Пореден номер	20157	Поредният номер на това събитие е различен.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
16	Код на сегмент MIC	XMIC	
17	Код за регистриране на нареждане	XYZ9876	
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000	
20	Код за идентифициране на поръчка		Празно като промяна в индикативните цена и обем.
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
50	Индикативна цена на търга	1	Без промяна в тръжната цена от 1 GBP.
51	Индикативен обем на търга	75	Обемът е 75 акции.

Събитие 5: Единен търг и начало на продължителна търговия

Ред 8 от данните показва частичното попълване на 50 акции в поръчката за покупка за 100 акции (не всички полета на поръчката са включени):

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 07:00:25.149531 ч.	Време на частично попълване.

Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 06:55:21.528754 ч.	Същото като времето за въвеждане тъй като поръчката все още е активна.
15	Пореден номер	20189	Поредният номер на това събитие е различен.
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC	
Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	PARF	
Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена	1	
28	Цена на сделката	1	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	BUYI	
36	Първоначално количество	100	
37	Останалото количество, включително скрито	50	
39	Търгувано количество	50	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	ABC123456	
Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

Ред 9 от данните показва попълването за 50 акции в поръчката за продажба за 50 акции (не всички полета на поръчката са включени):

Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване			
N	Поле		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 07:00:25.149531 ч.	Време на попълване.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет		Празно, тъй като поръчката вече не е активна.
15	Пореден номер	20190	Поредният номер на това събитие е различен.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на нареждане	987654321DEF	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	FILL	
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена		Празно като пазарна поръчка без цена.
28	Цена на сделката	1	
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
36	Първоначално количество	50	
37	Останалото количество, включително скрито	0	
39	Търгувано количество	50	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	ABC123456	

Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

Ред 10 от данните показва частичното попълване за 25 акции в поръчката за покупка за 50 акции (не всички полета на поръчката са включени):

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване		Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>				
9	Дата и час	27.06.2018 г., 07:00:25.149531 ч.		Време на частично попълване.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>				
13	Удостоверение за време за приоритет	27.06.2018 г., 06:55:21.528754 ч.		Същото като часът на въвеждане.
15	Пореден номер	20256		Поредният номер на това събитие е различен.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>				
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC		
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>				
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	PARF		
<b>Раздел И - Цени</b>				
24	Лимитирана цена	1		
28	Цена на сделката	1		
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>				
32	Показател за покупка-продажба	BUYI		
36	Първоначално количество	100		

37	Останалото количество, включително скрито	25	
39	Търгувано количество	25	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	DEF9876	
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

Ред 11 от данните показва попълването за 25 акции в поръчката за продажба за 25 акции (не всички полета на поръчката са включени):

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 07:00:25.149531 ч.	Време на попълване.
<b>Раздел Д - Приоритет и пореден номер</b>			
13	Удостоверение за време за приоритет		Празно като попълнено нареждане.
15	Пореден номер	20257	Поредният номер на това събитие е различен.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на нареждане	543216789GHI	
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	FILL	

Раздел И - Цени			
24	Лимитирана цена		Празно като пазарна поръчка без цена.
28	Цена на сделката	1	
Раздел Й - Инструкции за нареждането			
32	Показател за покупка-продажба	SELL	
36	Първоначално количество	25	
37	Останалото количество, включително скрито	0	
39	Търгувано количество	25	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	DEF9876	
Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем			
49	Фази на търговия		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
50	Индикативна цена на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.
51	Индикативен обем на търга		Празно, тъй като не се изисква за събитието.

Промяната на фазата на търговия следва да бъде представена от собствения си ред в рамките на данните, които се поддържат. Следователно, ред 12 съдържа следната информация като всички други полета остават празни. Единствените полета, които да бъдат запълнени, са:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване	Описание (когато е уместно)
Раздел В - Дата и час			
9	Дата и час	27.06.2018 г., 07:00:25.149531 ч.	Удостоверение за време с ниво на детайлност до 1 микросекунда.
Раздел Д - Приоритет и пореден номер			
15	Пореден номер	20258	Пореден номер на това събитие на мястото на търговия.
Раздел Е - Идентифициране на нареждане			
16	Код на сегмент МІС	ХМІС	Без промяна.
17	Код за регистриране на нареждане	ХYZ9876	Без промяна.

18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000	Без промяна.
20	Код за идентифициране на нареждане		Празно като промяна във фаза на търговия.
<b>Раздел К - Фази на търговия, индикативна цена на търга и обем</b>			
49	Фази на търговия	Продължителна търговия	Продължителната търговия е започнала

## 6.14 Системи за искане на котировка

В система за искане на котировка, котировка или котировки са осигурени в отговор на искане за котировка, подадено от един или повече членове или участници. Котировката се изпълнява изключително от искащия член или участник. Исканият член или участник може да приеме котировката или котировките, които са му предоставени. Настоящото приемане на котировка може да се случи автоматично между определени контрагенти.

Системата за искане на котировка има определени характеристики. За поддържане на съответните данни, свързани с тези конкретни характеристики, попълването на таблицата с полета трябва да бъде извършено по определен начин. Следователно, дадени са примери за следните специфични характеристики, свързани с искането на котировка:

Пример 141: Как се регистрира искане на котировка, което е изпратено до определени контрагенти?

Пример 142: Как да регистрирате отговор на котировка с ограничено време на валидност („ефирно време“), което е изпълнимо единствено за конкретен искащ котировка?

Пример 143: Как да регистрирате отговор на котировка с различно количество от поисканото?

Пример 144: Как да регистрирате изпълнение в система за искане на котировка?

### 6.14.1 Как се регистрира искане на котировка, което е изпратено до определени контрагенти

Искане за котировка следва да бъде регистрирано като нова поръчка с попълнен код за идентифициране на нареждане и събитието за поръчка (поле 21) следва да бъде попълнено с 'RFQS'. Като такова то се признава като подадено искане за котировка.

В допълнение, искането за котировка следва да бъде регистрирано като изпратено до пазара като цяло или до конкретни контрагенти. За тази цел, стратегия по пренасочване (поле 47) следва да се използва. Празно поле за стратегия по пренасочване следва да се използва за посочване, че искането за котировка е изпратено до всички членове или участници на мястото на търговия. От друга страна, LEI следва да бъде попълнено с полето стратегия по пренасочване за посочване, че искането за котировка е подадено до съответното дружество. Ако искането за котировка е изпратено до повече от едно дружество, за всяко дружество нов случай на таблица с полета (с последващи LEI в полето стратегия по пренасочване) следва да бъде регистриран, но за всеки случай съгласно същия код за идентифициране на поръчка.

### Пример 141

На място на търговия, свързано с искане за котировка на 27 юни 2018 г. в 13:05:10 ч. (координирано универсално време), инвестиционен посредник X изразява интерес за продажба в конкретен инструмент ISIN XX0000000000 като поисква едностранна котировка, включваща размер (1000) за продажба на този инструмент на членове, които отговорят на това искане за котировка. Искането за котировка е изпратено само до два определени члена: Инвестиционен посредник Y (LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) и инвестиционен посредник Z (LEI KLMNOPQRST1234567890). Как следва това да бъде отразено от мястото на търговия на искането за котировка в таблицата с полета?

Искане на котировка от инвестиционен посредник X до инвестиционен посредник Y:

N	Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>		
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката	12345678901234567890
<b>Раздел В - Дата и час</b>		
9	Дата и час	27.06.2018 г., 13:05:10 ч.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>		
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000
20	Код за идентифициране на нареждане	123456789ABC
21	Ново нареждане, промяна на нареждане, отмяна на нареждане, отхвърляне на нареждане, частично или пълно изпълнение	RFQS <sup>49</sup>
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	SELL
36	Първоначално количество	1000
47	Стратегия по пренасочване	ABCDEFGHIJKLMNQRST

б) Искането за котировка до инвестиционен посредник Z (което ще бъде точно същото попълване на таблицата с полета като горепосоченото (включително същия код за идентифициране на

<sup>49</sup> Този код не е споменат в РТС, но попада в {ALPHANUM-4} полето за свободен формат. Все пак, местата на търговия се очаква да използват този конкретен код за конкретния случай.



нареждане), но единствената разлика е, че LEI на инвестиционен посредник Z се попълва в полето стратегия по пренасочване)

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
20	Код за идентифициране на поръчка		123456789ABC
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
47	Стратегия по пренасочване		KLMNOPQRST1234567890

Примери на актуализация на котировки можете да прочетете в раздел 6.13.1.2.

6.14.2 Как да регистрирате отговор на котировка с ограничено време на валидност („ефирно време“), което е изпълнимо за конкретен искащ котировка?

Пример 142

Инвестиционен посредник Y отговаря на искането за котировка на инвестиционен посредник X от пример 141 по-горе като отговаря с едностранна котировка (купува) при 8750 EUR за поискания размер (1000) за инструмент ISIN XX0000000000 на 27 юни 2018 г. в 13:06:07 ч. (координирано универсално време), която е валидна 10 минути и изпълнима до искащия котировката инвестиционен посредник X. Отговор на котировка се признава, като събитието на поръчка (поле 21) следва да бъде попълнено с 'RFQR'. Връзката между искащия котировката и отговарящия на котировката се осъществява чрез попълване на полето ограничение на нареждане (поле 11) с код за идентифициране на нареждане, което се регистрира от място на търговия на искането за котировка при съответното искане за котировка (вж. пример 141).

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката		ABCDEFGHIJKLMNQRST
<b>Раздел В - Дата и час</b>			
9	Дата и час		27.06.2018 г., 13:06:07 ч.
<b>Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>			
10	Период на валидност		GTSV
11	Ограничение за нареждането		123456789ABC

12	Дата и час на периода на валидност	27.06.2018 г., 13:16:07 ч.
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>		
18	Идентификационен код на финансови инструменти	XX0000000000
20	Код за идентифициране на поръчка	23456789DEF
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>		
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	RFQR <sup>50</sup>
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>		
22	Тип на нареждането	Лимит
23	Класификация на типа на нареждането	LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>		
24	Лимитирана цена	8.750
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
36	Първоначално количество	1000

### 6.14.3 Как да регистрирате отговор на котировка с различно количество от поисканото?

#### Пример 143

Инвестиционен посредник Z отговаря на искането за котировка от пример 141 като публикува едностранна котировка (купува) при 8750 EUR за различен обем от поискания размер (поисканото от инвестиционен посредник X беше 1000, инвестиционен посредник Z отговаря с 600) за инструмент ISIN XX0000000000, който е изпълним за искащия котировка, инвестиционен посредник X. Връзката между искащия котировка и предоставящия котировка се осъществява чрез попълване на полето ограничение за поръчка (Поле 11) с код за идентифициране на нареждане, който е регистриран от място на търговия на искането за котировка при съответното искане за котировка (вж. пример 141).

<sup>50</sup> Този код не е споменат в РТС, но попада в {ALPHANUM-4} полето за свободен формат. Все пак, местата на търговия се очаква да използват този конкретен код за конкретния случай.

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел А - Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката		KLMNOPQRST1234567890
<b>Раздел Г - Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>			
11	Ограничение за нареждането		123456789ABC
<b>Раздел Е - Идентифициране на нареждане</b>			
18	Идентификационен код на финансови инструменти		XX0000000000
20	Код за идентифициране на нареждане		78901223GHI
<b>Раздел Ж - Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение		RFQR <sup>51</sup>
<b>Раздел З — Тип на нареждането</b>			
22	Тип на нареждането		Лимит
23	Класификация на типа на нареждането		LMTO
<b>Раздел И - Цени</b>			
24	Лимитирана цена		8.750
<b>Раздел Й - Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба		BUYI
36	Първоначално количество		600

#### 6.14.4 Как да регистрирате изпълнение в система за искане на котировка?

##### Пример 144

Искащият котировка, инвестиционен посредник X, изпълнява отговора на котировка, предоставен от инвестиционен посредник Y от пример 142. Сделката, произтичаща от това, е показана от две събития за изпълнение на искащия котировката, инвестиционен посредник X и предоставящия котировката, инвестиционен посредник Y. Идентификационният код на сделка на мястото на търговия (поле 48) следва да бъде попълнен на всяко от събитията за показване на двете котировки, които участват в сделката. Като извършите това, пълна одитна следа от искането за котировка, съответният отговор на котировка и съответната сделка могат да бъдат осъществени.

<sup>51</sup> Този код не е споменат в РТС, но попада в {ALPHANUM-4} полето за свободен формат. Местата на търговия все пак се очаква да използват този конкретен код за конкретния случай.

Първата таблица показва събитието за изпълнение, свързано с искане за котировка за инвестиционен посредник X:

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел А Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката		12345678901234567890
<b>Раздел Г Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията</b>			
11	Ограничение за нареждането		
<b>Раздел Е - Идентификационен код на нареждането</b>			
20	Код за идентифициране на поръчка		123456789ABC
<b>Раздел Ж -Събития, които оказват влияние на нареждането</b>			
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение		FILL
<b>Раздел I Цени</b>			
28	Цена на сделката		8.750
<b>Раздел Й -Инструкции за нареждането</b>			
32	Показател за покупка-продажба		SELL
39	Търгувано количество		1000
47	Стратегия по пренасочване		ABCDEFGHIJKLMNQRST
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия		GHIJ1234

Втората таблица показва събитието за изпълнение, свързано с искане за котировка за инвестиционен посредник Y:

N		Поле	Стандарти и формати на данните на нареждането, които да бъдат използвани при осигуряването на данните за съответното нареждане на компетентния орган при поискване
<b>Раздел А Идентификация на съответните страни</b>			
1	Идентификация на дружеството, което е предало поръчката		ABCDEFGHIJKLMNQRST

Раздел Г Срок на валидност и ограничения по отношение на нарежданията		
11	Ограничение за нареждането	123456789ABC
Раздел Е - Идентификационен код на нареждането		
20	Код за идентифициране на нареждане	23456789DEF
Раздел Ж -Събития, които оказват влияние на нареждането		
21	Ново нареждане, промяна, отмяна, отхвърляне, частично или пълно изпълнение	FILL
Раздел I Цени		
28	Цена на сделката	8.750
Раздел Й -Инструкции за нареждането		
32	Показател за покупка-продажба	BUYI
39	Търгувано количество	1000
47	Стратегия по пренасочване	
48	Идентификационен код на сделката, зададен от мястото на търговия	GHIJ1234

## 7 Насоки относно синхронизирането на часовниците

Член 50 на ДПФИ II и свързаните регулаторни технически стандарти се прилагат за места на търговия и техните членове и участници и изисква от тях да спазват изискванията за точност по отношение на максималното отклонение на техните бизнес часовници от координираното универсално време и да удостоверяват за време подлежащи на отчитане събития до определено ниво на детайлност.

### 7.1 Събития, подлежащи на отчитане

Член 50 от ДПФИ II се отнася до задължението на местата на търговия и техните членове/участници да синхронизират използваните от тях бизнес часовници за регистриране на датата и времето на всяко „подлежащо на отчитане събитие“. ESMA счита, че е от значение предоставянето на примери за „подлежащи на отчитане събития“ за целите на член 50.

ESMA счита, че „подлежащо на отчитане събитие“ включва всяко от следните задължения:

- Публикуването на времето за търговия и времето за публикуване, както е предписано в приложение I, таблица 3 от РТС 1 и приложение II от таблица 16 от РТС 2 относно прозрачността за капиталови, сходни с капиталови и некапиталови инструменти съгласно членове 6, 7, 10 и 11 от Регламента за пазарите на финансови инструменти;

- Отчитане на сделка на времето за търговия, както е предвидено в поле 28 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията съгласно член 26 на Регламента за пазарите на финансови инструменти;
- Документиране на времето на събития, което влияе на поръчките и сделките, осъществени от инвестиционните посредници съгласно член 25, параграф 1 от Регламента за пазарите на финансови инструменти и изискванията за документиране (различни от записване на телефонни разговори или друга електронна комуникация), произтичащи от член 16, параграф 6 от ДПФИ II, както е предписано в член 74 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/565 на Комисията от 25.4.2016 г. (изискванията съгласно ДПФИ II, член 16, параграф 6);
- Документиране на време, свързано със събития, което влияе на поръчките, както е посочено в поле 27 от таблица 2 и полета 23, 24 и 33 от таблица 3 на приложение II към РТС 6 съгласно член 17, параграф 2 от ДПФИ II за инвестиционни посредници, които работят с високочестотни алгоритмични техники за търговия;
- Документиране на времето, свързано със събития, което оказва влияние на поръчките, както е посочено в полета 9, 12, 13 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията съгласно член 25, параграф 2 от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

## 7.2 Ниво на детайлност на удостоверението за време

Член 50 от ДПФИ II е приложим за широк кръг от подлежащи на отчитане събития (раздел 7.1). Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията посочва два вида изисквания за точност: максимално отклонение от координираното универсално време и ниво на детайлност на удостоверението за време. Този раздел от насоките се отнася единствено за последното изискване.

Следва да бъде отбелязано, че член 50 от ДПФИ II се прилага единствено за подлежащи на отчитане събития, които се случват на място на търговия. Например, това не е приложимо за извънборсови сделки.

Член или участник на място на търговия не се изисква да спазва същите изисквания за удостоверение за време, които се прилагат за мястото на търговия, на което той е член или участник. Член или участник следва да извършва единствено удостоверение за време съгласно изискванията, които са приложими за свързаната с търговия дейност на неговото дружество съгласно член 50 от ДПФИ II.

В случая, когато сделка е изпълнена посредством верига от инвестиционни посредници (така че първоначалната поръчка е предадена по веригата от един инвестиционен посредник на друг), всеки инвестиционен посредник в рамките на веригата следва да спазва изискванията за удостоверение за време, приложими за неговата собствена свързана с търговия дейност, без значение на изискванията за удостоверение за време, приложими за други инвестиционни посредници във веригата.

*Регламент за пазарите на финансови инструменти, член 26 и ДПФИ II, член 16, параграф 6 - Отчитане на сделки и документиране на сделки и обработка на поръчки*

#### 7.2.1.1 Сделки, извършени на място на търговия

Когато инвестиционен посредник изпълнява сделка на място на търговия (напр. като член или участник на място на търговия), тогава то следва да отчете полето дата и време на търгуване в отчета за сделка, като използва нивото на детайлност, посочено в Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията за сделки, изпълнени на място на търговия. Това е посочено в раздел 5.4 „Изпълнение на сделка на място на търговия“ в част I от настоящите насоки. По подобен начин, инвестиционните посредници, които попадат в обхвата на изискванията на член 16, параграф 6 от ДПФИ II следва да отчетат времето на сделките, изпълнени на местата на търговия и поръчки, подадени до място на търговия като се използва същото ниво на детайлност, както е посочено в Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията.

#### 7.2.1.2 Сделки, които не са извършени на място на търговия

Всички инвестиционни посредници (независимо дали са член или участник на място на търговия) следва да удостоверят за време своите отчети за сделки до второ ниво на детайлност или по-добро в съответствие с поле 28 на таблица 2 в приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията за сделки, които не са изпълнени на място на търговия. По подобен начин, инвестиционните посредници, които попадат в обхвата на изискванията на член 16, параграф 6 от ДПФИ II, следва да отчитат времето на сделките, които не са изпълнени на място на търговия и поръчки, които не са подадени до местата на търговия до най-близката секунда.

За сделки, които не са изпълнени на място на търговия (т.е. извънборсови сделки), Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията гласи, че датата и времето в отчета за сделка следва да бъдат „когато страните договорят съдържанието на определени полета“.

#### 7.2.1.3 Примери:

По-долу са предоставени примери за показване как да се удостоверят за време данни за поръчки и отчети за сделки. Следва да бъде отбелязано, че като се има предвид, че времената са в координирано универсално време +1, удостоверенията за време следва да бъдат коригирани на координирано универсално време. В следните примери се допуска, че инвестиционен посредник X и инвестиционен посредник Y са инвестиционни посредници, които имат задължения за отчитане на сделки съгласно член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти.

##### Пример 145: Поръчки и сделки на мястото на търговия

Инвестиционен посредник X получава поръчка на 20 юни 2018 г. за паричен капиталов инструмент от клиент чрез електронно съобщение в 12:11:38.077312 ч. (координирано универсално време +1). Инвестиционен посредник X автоматично обработва това съобщение и използва своя алгоритъм, който подава поръчка до място на търговия M в 12:11:38.236931 ч. (координирано универсално време +1). Място на търговия M получава поръчката в 12:11:38.478598 ч. (координирано универсално време +1) (поръчка 1). Инвестиционен посредник X използва високочестотна алгоритмична техника за търговия по смисъла на член 4, параграф 1, точка 40 от ДПФИ II Директива (ЕС) 2014/65 във връзка с тази поръчка.

Инвестиционен посредник Y подава поръчка на 20 юни 2018 г. за паричен капиталов инструмент до място на търговия M в 13:42:29.327087 ч. (координирано универсално време +1). Поръчката е получена от място на търговия M в 13:42:29.561123 ч. (координирано универсално време

+1)(поръчка 2). Инвестиционен посредник Y използва електронна система, която не попада в определението на член 4, параграф 1, точка 40 от Директива (ЕС) 2014/65/ЕС ДПФИ II.

Закъснението „от вход до вход“ на място на търговия M за неговия електронен основен софтуерен компонент е 350 микросекунди.

Член 25 от Регламента за пазарите на финансови инструменти и член 17 от ДПФИ II - документиране на данни за поръчки

Място на търговия M следва да регистрира събитието за поръчка като използва ниво на детайлност до микросекунда или по-добро, защото неговото закъснение „от вход до вход“ е по-малко от 1 милисекунда. За поръчка 1 поле 9 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията следва да бъде попълнено с 20.06.2018 г. 11:11:38.478598 ч., а за поръчка 2, поле 9 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията следва да бъде попълнено с 20.06.2018 г., 12:42:29.561123 ч.

Инвестиционен посредник X следва да регистрира събитие на поръчка като използва ниво на детайлност до милисекунда или по-добро, тъй като дейността е генерирана от инвестиционен посредник X чрез използване на високочестотна алгоритмична техника за търговия (вж. таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията). Използваното удостоверение за време кога клиентската поръчка е получена следва да бъде 20.06.2018 г. в 11:11:38.077312 ч. Използваното удостоверение за време кога поръчката е подадена до мястото на търговия следва да бъде 20.06.2018 г. в 11:11:38.236931 ч.

Инвестиционен посредник Y следва да отчете събитие на поръчка като използва ниво на детайлност до милисекунда или по-добро тъй като дейността беше генерирана чрез използване на електронна търговия, която попада в последния ред на таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията като „всяка друга търговска дейност“. Удостоверението за време следва да бъде 20.06.2018 г., 12:42:29.327 ч.

Член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти - отчитане на сделка

Ако поръчките на инвестиционен посредник X и инвестиционен посредник Y са изпълнени на място на търговия M, то дружество X и дружество Y следва да подадат отчети за сделки всеки от тях.

Инвестиционен посредник X следва да попълни поле 28 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (Дата и време на търгуване) като използва ниво на детайлност до микросекунди или по-добро за отчета за сделка, който показва изпълнението на пазара. Инвестиционен посредник Y следва да използва ниво на детайлност до милисекунда или по-добро за отчитане на сделки, което показва изпълнението на пазара.

Пример 146: Сделки, които не са извършени на място на търговия

Продължение на пример 145: Като се допуска, че инвестиционен посредник X е придобил паричния капиталов инструмент на място на търговия M, ако инвестиционен посредник X тогава е продал този инструмент на своя клиент, инвестиционен посредник X следва да се изисква да подаде отчет за сделка. Съгласно поле 28 „дата и време на търгуване“ от таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията, инвестиционен посредник



X следва да попълни датата и времето на търговия в своя отчет за сделка до ниво на детайлност секунда или по-добро.

#### Пример 147: Поръчки и сделки на мястото на търговия

Инвестиционен посредник X подава поръчка за глобална депозитарна разписка на място на търговия А в 15:01:25.369310 ч. (координирано универсално време+1) на 20 юни 2018 г., която е получена от място на търговия А в 15:01:25.458482 г.

В този случай, различен електронен основен софтуерен компонент на място на търговия А се използва за разлика от пример 116. Закъснението „от вход до вход“ на този основен софтуерен компонент е 1.2 милисекунди.

Инвестиционен посредник X е използвал електронна система, която не попада в определението на член 4, параграф 1, точка 40 от ДПФИ II за подаване на поръчката.

#### Член 25 от Регламента за пазарите на финансови инструменти и член 17 от ДПФИ II - документиране на данни за поръчки

Място на търговия А следва да регистрира събитието за поръчка като използва ниво на детайлност до милисекунда или по-добро, защото неговото закъснение „от вход до вход“ е по-голямо от 1 милисекунда. Поле 9 на Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията следва да бъде попълнено с 20.06.2018 г., 14:01:25.458 ч..

Инвестиционен посредник X следва да отчете събитие на поръчка като използва ниво на детайлност до милисекунда или по-добро, защото дейността беше генерирана чрез използване на електронна търговия, която попада в последния ред на таблица 2 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията като „всяка друга търговска дейност“. Удостоверението за време следва да бъде 20.06.2018 г., 14:01:25.369 ч.

#### Член 26 от Регламента за пазарите на финансови инструменти - отчитане на сделка

Ако поръчката на инвестиционен посредник X е изпълнена на място на търговия А, то инвестиционен посредник X следва да попълни поле 28 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/590 на Комисията (дата и време на търгуване) като използва ниво на детайлност до милисекунди или по-добро за отчета за сделка, който показва изпълнението на пазара.

За верига с крайно изпълнение на място на търговия единствено отчетът за пазара на мястото на търговия трябва да бъде отчетен с ниво на детайлност, посочено в член 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията, а другите отчети единствено се изисква да бъдат изготвени до секунди, въпреки че по-добро ниво на детайлност може да бъде отчетено. Инвестиционни посредници, които подават поръчки до други дружества, могат да отчетат времето за изпълнение, съобщено от изпълняващото дружество с гласово или електронно съобщение в полето за дата и време на търговия.

### 7.3 Спазване на изискванията за максимално отклонение

Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията посочва два вида изисквания за точност: максимално отклонение от координираното универсално време и ниво на детайлност на

удостоверението за време. Този раздел от насоките се отнася единствено за предишното изискване. Член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията гласи, че „Операторите на места на търговия и техните членове или участници установяват система за проследяване спрямо UTC“. Това включва гарантиране, че техните системи работят в рамките на ниво на детайлност и максимално толерирано отклонение от координираното универсално време съгласно Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията. В допълнение, операторите на места на търговия и техните членове или участници следва да удостоверят, че използваните значими компоненти на системата отговарят на равнищата на стандарта за точност относно нивото на детайлност и максималното отклонение на координираното универсално време, както е гарантирано и посочено от производителя на подобни компоненти на системи (спецификациите на компонентите следва да отговарят на изискваните равнища на точност) и че тези компоненти на системата са инсталирани в съответствие с насоките за инсталиране на производителя.

Значимо и пропорционално изпитване на системата следва да се изисква заедно с техния значим и пропорционален мониторинг за гарантиране, че отклонението от координираното универсално време остава в рамките на допустимото. Значението и пропорционалността зависят от приложимото максимално отклонение от координираното универсално време.

Съгласно член 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията, системи, които осигуряват пряка проследяемост до координирано универсално време, създадено и поддържано от центъра за време, посочен в годишния отчет на Международното бюро за мерки и теглилки (BIPM) за дейностите във връзка с времето, се считат за приемливи за отчитане на подлежащи на отчитане събития. Използването на източника на време на Американската глобална система за определяне на местоположението (GPS) или всяка друга глобална навигационна сателитна система, като руската GLONASS или европейската сателитна система „Галилей“, когато започне да работи, също е приемливо за отчитане на подлежащи на отчитане събития, при условие че всяко компенсирание от координираното универсално време е отчетено и премахнато от удостоверението за време. Времето по GPS е различно от координираното универсално време. Все пак, съобщението за време по GPS също включва компенсирание от координираното универсално време (бързите секунди) и това компенсирание следва да бъде комбинирано с удостоверение за време по GPS за осигуряване на удостоверение за време в съответствие с изискванията за максимално отклонение в Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията. Потребителите на подобни системи следва да са наясно със съответните рискове, свързани с тяхното ползване, като блясък на слънцето, интерференция, смущения или отражения на множество пътеки и че приемателят е правилно свързан със сигнала. Следователно подходящи мерки следва да бъдат взети за гарантиране, че тези рискове са сведени до минимум. По-специално, препоръката за радио комуникация на Международния съюз по далекосъобщения TF.1876 относно доверения източник на време<sup>52</sup> следва да бъде отчетена от дружествата, които планират да използват GPS приематели, които попадат в обхвата на по-строги изисквания за точност.

За целите на член 4 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията, за потребители на сателитна система, изискваната точност съгласно РТС следва да се прилага за всяка точка в рамките на границата на домейн системата, където се измерва времето. Все пак, първата точка, при която планът, функционирането и спецификациите на системата следва да бъдат отчетени е относно използвания приемател (напр. модела на GPS приемател и изградената точност на GPS приемателя) за получаване на съобщение за удостоверение за време от сателита (и всяка

---

<sup>52</sup> Препоръка TF.1876-0 (04/2010), достъпна на <https://www.itu.int/rec/R-REC-TF.1876-0-201004-I/en>.

свързана антена). Това не следва да включва GPS сателитна система и проследяемост на сателити до координирано универсално време

### 7.3.1 Бързи секунди

Когато бърза секунда трябва да бъде добавена или извадена от координираното универсално време, както е обявено периодично от Международната служба за въртене на Земята и референтни системи (IERS), това следва да бъде обработено в съответствие с препоръка за радио комуникация на Международния съюз по далекосъобщения TF.460-6. Тази препоръка гласи, че положителна бърза секунда започва в 23:59:60 ч. и завършва в 00:00:00 ч., а отрицателна бърза секунда е представена от времето от 23:59:58 ч. до 00:00:00 ч.

### 7.3.2 Местно време и компенсирани от координираното универсално време

Удостоверенията за време могат да бъдат поддържани в местно време, при условие, че когато данните бъдат предоставени на компетентния орган удостоверението за време се конвертира в координирано универсално време („зулу“ време). Някои съобщения за удостоверения за време могат да се състоят от удостоверение за време и отклонение от координираното универсално време, приложимо за това удостоверение за време. Отново, относно удостоверенията за време, предоставени на компетентен орган, отклонението следва да бъде приложено за удостоверението за време, така че единствено едно удостоверение за време е предоставено на компетентния орган.

### 7.3.3 Приложимост за инвестиционни посредници, които не са преки членове или участници на място на търговия

Член 50 от ДПФИ II е приложим единствено за места на търговия и техните членове или участници. Все пак, изискванията на РТС 6 от Регламента за пазарите на финансови инструменти и член 16, параграф 6 от ДПФИ II се прилагат за инвестиционни посредници без значение дали те извършват действия като членове или участници на място на търговия. Позоваването на изискванията за максимално отклонение в тези два регламента следва да се разбира като единствено приложимо за инвестиционни посредници, когато извършват действия като членове или участници на места на търговия, тъй като това е в съответствие с обхвата на задължението, определено в текста от равнище 1.

## 7.4 Удостоверения за време за приложение, хост и ефирно време

Удостоверенията за време за приложение и хост са генерирани в рамките на софтуерното приложение, а удостоверенията за време за ефирно време са генерирани от отделен хардуер, като също вземат копие на мрежовите пакети, съдържащи съответната информация. ESMA счита, че всяко от тези удостоверения за време ще бъде приемливо за използване от членове или участници. Местата на търговия следва да отбележат, че като се имат предвид изискванията за регистриране на събития в основния софтуерен компонент вероятно ще се изисква използването на удостоверения за време за приложение.

## 7.5 Закъснение „от вход до вход“

Местата на търговия могат да изброят множество закъснения „от вход до вход“ за различни процентни стойности. За целите на синхронизиране на часовници, ESMA счита, че местата на търговия следва да използват закъснение „от вход до вход“ при 99<sup>та</sup> процентна стойност.

Местата на търговия имат задължения да наблюдават в реално време закъснението „от вход до вход“ съгласно член 13, буква в) (ESMA/2015/1464)<sup>53</sup>. Ако закъснението „от вход до вход“ се подобрява от повече от 1 милисекунда до по-малко или равно на една милисекунда, то техните изисквания съгласно член 50 за нивото на детайлност и максималното отклонение се променят. Този тип сценарий е най-вероятно да се случи след промяна в нов основен софтуерен компонент или подобрения в технологията в съществуващата инфраструктура на мястото и следователно изискванията за удостоверение за време следва да бъдат отчетени, когато подобна работа е планирана.

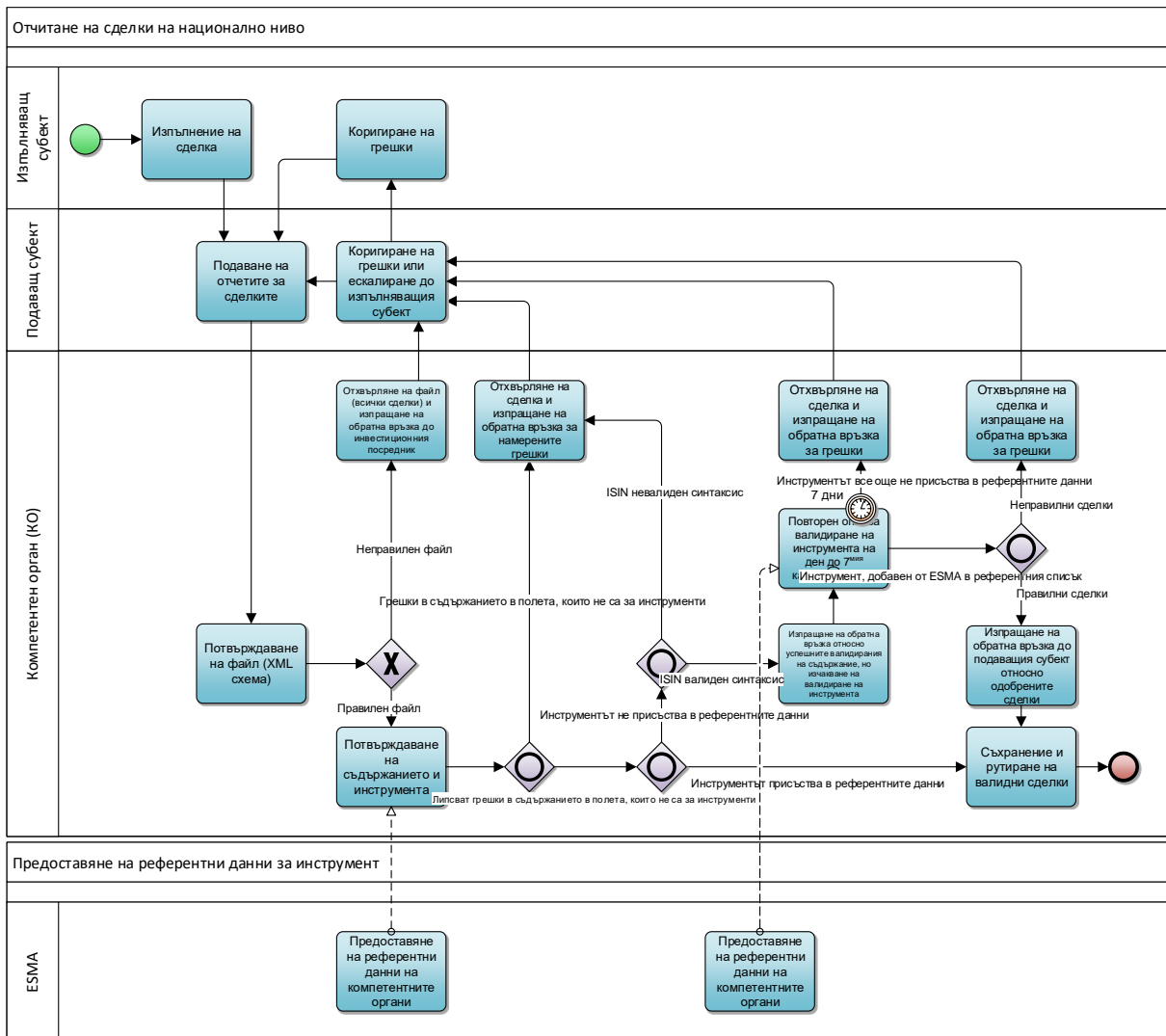
---

<sup>53</sup> Делегиран регламент (ЕС) 2017/584 на Комисията от 14.7.2016 г. за допълване на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти, с които се уточняват организационните изисквания към местата на търговия.

## 8 Приложения

### Приложение I Обработка на отчети, получени от подаващи субекти

Диаграмата по-долу представя процеса на отчитане на сделка на национално равнище:



Следната таблица обобщава сроковете за ключовите събития в процеса:

Означаване	Задача	Срок
T	Изпълнение на сделка	
R	Подаване на отчети за сделки от отчитащото се предприятие	T+1 работен ден

	Осигуряване на обратна връзка на отчитащите се предприятия	R+1 календарен ден (R+7 в случай на инструмент, който липсва в референтните данни)
--	--	--

Сделки, изпълнени в ден T, се отчитат не по-късно от края на следващия работен ден, т.е. T+1.

Всеки компетентен орган има право на преценка да определи подробни технически процедури и графици за подаване на отчети.

Компетентните органи трябва да потвърдят входящите отчети по следния начин:

Валидиране на файл – потвърждаване на съответствието на файла с XML схема (синтаксис на целия файл и конкретни отчети за сделки). Ако файлът не съответства, целият файл (всички сделки, включени във файла) бива отхвърлен.

Валидиране на съдържание – набор от правила за валидиране, които са изпълнени за всеки отчет за сделка и потвърждават съдържанието на конкретни полета. Неправилните отчети за сделки се отхвърлят, като правилните сделки се обработват при следващите стъпки. Правилата за валидиране включват валидирания, в зависимост от референтните данни на инструмента.

Всеки компетентен орган следва да приложи валидирания на файлове. Тези правила за валидиране проверяват дали синтаксисът на XML файла е правилен.

След успешното валидиране на файл всички правила за валидиране на съдържание следва да бъдат изпълнени за всеки отчет за сделка, включен във файла. Правилата за съдържание по-специално включват потвърждение дали самият инструмент или основният инструмент (в случай на някои извънборсови сделки или сделки с дериватни инструменти, изпълнени на организирана платформа за търговия извън Съюза), за който сделката е изпълнена, е включен в референтните данни и дали отчетеният ISIN код е правилен по отношение на синтаксис / число за проверка. Следните случаи могат да бъдат взети предвид:

Ако отчетът за сделка е правилен (всички правила за съдържание са правилни) и отчетеният инструмент съществува в референтните данни → отчетът за сделка е приет;

Ако липсват грешки в съдържанието, свързани с полетата различни от инструмента / основния инструмент, но отчетеният инструмент липсва в референтните данни и синтаксисът / числото за проверка на отчетения ISIN е вярно → следните стъпки трябва да бъдат извършени:

компетентният орган следва да информира подаващото дружество, че сделката изчаква валидирането на инструмента;

компетентният орган следва да изпълни валидирането на инструмента всеки ден до 7-мия календарен ден след получаването на отчета от подаващото дружество;

ако инструментът присъства в референтните данни преди 7 календарни дни да са изтекли и не съществуват грешки в съдържанието в резултат на валидиране на инструмента, сделката бива приета;

ако инструментът присъства в референтните данни преди 7 календарни дни да са изтекли и е налице грешка(и) в съдържанието в резултат на валидиране на инструмента, сделката бива отхвърлена;

Ако след 7 календарни дни инструментът все още не присъства в референтните данни, компетентният орган отхвърля отчета за сделка и изпраща съответното съобщение на подаващото дружество;

Ако липсват грешки в съдържанието, свързани с полетата различни от инструмента / основния инструмент, но отчетеният инструмент липсва в референтните данни и числото за проверка на отчетения ISIN е грешно → сделката се отхвърля незабавно;

ако съществуват грешки в съдържанието, свързани с полета различни от инструмента / основния инструмент → сделката се отхвърля незабавно, т.е. без изчакване за допълнителни 7 дни. Обратна връзка за всички установени грешки следва да бъде осигурена.

Валидиранията на съдържание се прилагат единствено за файлове, които успешно са преминали валидирането на равнище файл. Всяко от правилата за валидиране следва да се прилага за всеки отчет за сделка във файла.

Ако отчет за сделка не е в съответствие с едно или повече правила за валидиране, подобен отчет се отхвърля. Отчети, които спазват правилата за валидиране, следва да бъдат приети. Може да се случи някои от данните за сделки, включени в един файл, да бъдат приети, а някои отхвърлени. В контекста на Регламента за пазарите на финансови инструменти член 26, параграф 7, последна алинея, подаващото дружество следва да действа надлежно при всеки отказ да се гарантира, че грешките са коригирани без основателно закъснение. За валидиране на сделки, изпълнени в ден Т, компетентните органи използват референтни данни към ден Т. За да се справят с въпроси, свързани с късното отчитане на сделки или референтни данни, за сделки валидирани или насочени по-късно от Т+1 компетентните органи следва да използват последните налични референтни данни в деня на изпълнение на валидирането, напр. ако сделка, която е изпълнена в ден Т, е получена от инвестиционния посредник в ден Т+10, тази сделка следва да бъде валидирана чрез използване на последните налични референтни данни в деня на валидиране.

Файлове с обратна връзка следва да бъдат създадени и изпратени на подаващите субекти не по-късно от един ден след подаване на отчета (т.е. R+1, където R е деня на отчитане). Това включва потвърждения за правилното подаване на отчети за сделките, както и съобщения за грешки, в случай че подадени отчети за сделки или цели файлове са сгрешени. Ако отчет за сделка бъде отхвърлен, съобщението за обратна връзка следва да посочва правилото за валидиране, което е изпълнено и естеството на грешката.