

Описание на структурата на репортите

Делегиран Регламент (ЕС) 2017/ 575

ЮНИ 2018

Версия 1.0

Европейската комисия, като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз, като взе предвид 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 прие в регламент установяване на конкретно съдържание, формата и периодичността на данните, които трябва да се публикуват от местата за изпълнение, относно качеството на изпълнение на сделки.

Този документ описва съдържанието на всяка от съответните таблици и служи да помогне при работата с данните в тях.

Данните, които са публикувани като обеми по сделките и цените на поръчки и сделки са в лева, BGN.

Всяка от таблиците е публикувана в машино четим формат. Те са структурирани в CSV формат с разделител (;). Всеки един файловете има следната конвенция:

MMMM_TABLEN_YYYYMMDD_YYYYMMDD.CSV

където

-MMMM - MIC кода на пазара

-TABLEN - таблица номер - N

-YYYYMMDD - година, месец и дата.

Файловете са дадени в начален и краен период на справка.

Финансовите инструменти, които са търгувани за съответния период са подадени в таблица 2.

Във всяка таблица, където са предоставени данните по емисии, са предоставени само тези по които има подадени нареждания или има

изпълнени сделки. Ако емисията не фигурира, означава че за съответния ден не са подавани нареждания или има сделки.

Таблица 1 - идентификация на вида на мястото за изпълнение

NAME;LEI;COUNTRY; AUTHORITYCOUNTRY;MIC;DATE;OUTAGENATURE;
OUTAGENUMBER; OUTAGEAVERAGEDURATION; AUCTIONNATURE;
AUCTIONNUMBER;AUCTIONAVERAGEDURATION;
FAILEDTRANSACTIONSNUMBER; FAILEDTRANSACTIONSPERCENTAGE;

NAME - Найменование на място на изпълнение;

LEI - Идентификатор на място на изпълнение;

COUNTRY - Държава;

AUTHORITYCOUNTRY - Компетентен орган;

MIC - MIC код на място на изпълнение;

DATE - дата на деня на търговия;

OUTAGENATURE - естество на прекъсванията;

OUTAGENUMBER - брой на прекъсванията;

OUTAGEAVERAGEDURATION - средна продължителност на прекъсванията;

AUCTIONNATURE - естество на аукционите;

AUCTIONNUMBER - брой на аукционите;

AUCTIONAVERAGEDURATION - средна продължителност на аукционите;

FAILEDTRANSACTIONSNUMBER - брой на неуспешните сделки;

FAILEDTRANSACTIONSPERCENTAGE - процент на неуспешните сделки;

Таблица 2 - идентификация на вида на финансовия инструмент

MIC;ISIN;EMISSIONNAME;CFI;CURRENCY

MIC - MIC код на място на изпълнение;

ISIN - ISIN на емисията;

EMISSIONNAME - Найменование на емисията;

CFI - CFI код;

CURRENCY - Валута

**Таблица 3 - информация за цените, подлежащи на публикуване
съгласно чл. 4, буква (а)**

MIC;DATE;REFERENCETIME;SIZERANGE;ISIN;AVGEXECUTEDPRICE;TOTAL
VALUE;EXECUTEDPRICE;EXECUTEDVALUE;EXECUTIONTIME;TRADINGMO
DE;TRADINGPLATFORM;REFERENCEPRICE

MIC - MIC код на място на изпълнение;

DATE - дата на деня на търговия;

REFERENCETIME - Референтни часове;

SIZERANGE - Обхват на размера;

ISIN - ISIN на емисията;

AVGEXECUTEDPRICE - Средноаритмитична цена на изпълнение на
сделките;

TOTALVALUE - Обща стойност на изпълнение;

EXECUTEDPRICE - Цена;

EXECUTEDVALUE - Размер на сделката;

EXECUTIONTIME - Час на сделката;

TRADINGMODE - Модел за търговия;

TRADINGPLATFORM - Платформа за търговия;

REFERENCEPRICE - Най - добра цена купува и продава или подходяща
референтна цена в момент на изпълнението

Таблица 4 - информация за цените, подлежащи на публикуване съгласно чл. 4, буква (б)

MIC;DATE;ISIN;AVERAGETRANSACTIONPRICE;VOLWEIGHTAVGTRANSACTIONPRICE;HIGHESTEXECUTEDPRICE;LOWESTEXECUTEDPRICE

MIC - MIC код на място на изпълнение;

DATE - дата на деня на търговия;

ISIN - ISIN на емисията;

AVERAGETRANSACTIONPRICE - средноаритметична цена, по която са сключени сделките;

VOLWEIGHTAVGTRANSACTIONPRICE - среднопретеглена спрямо обема цена, по която са сключени сделките;

HIGHESTEXECUTEDPRICE - Най-висока цена, на която е изпълнена сделката;

LOWESTEXECUTEDPRICE - Най-ниска цена, на която е изпълнена сделката;

Таблица 5 - информация за разходите, подлежащи на публикуване съгласно член 5

WEBADDRESS;REBATES_IN_PERCENT;COSTS_IN_PERCENT

WEBADDRESS - Електронна връзка, където е дадена допълнителна информация за разходите;

REBATES_IN_PERCENT - Обща стойност на всички предложени отстъпки в проценти;

COSTS_IN_PERCENT - Обща стойност на всички разходи в проценти;

Таблица 6 - информация относно вероятността за изпълнение, подлежаща на публикуване съгласно член 6

MIC;DATE;ISIN;NUMORDERSRCVD;NUMTRADESEXEC;VALUETRADESEXEC;NUMORDERSCANCD;NUMORDERSMOD;MEDSIZETRADES;MEDSIZEORDERS;NUMBMARKETMAKERS

MIC - MIC код на място на изпълнение;

DATE - дата на деня на търговия;

ISIN - ISIN на емисията;

NUMORDERSRCVD - Брой получени нареждания;

NUMTRADESEXEC - Брой изпълнени сделки;

VALUETRADESEXEC - Обща стойност на изпълнените сделки;

NUMORDERSCANCD - Брой на анулирани или оттегли нареждания;

NUMORDERSMOD - Брой получени нареждания, които са били изменени;

MEDSIZETRADES - Медианен размер на сделките;

MEDSIZEORDERS - Медианен размер на получените нареждания;

NUMBMARKETMAKERS - Брой на определените маркет-майкери