

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Регулаторни технически стандарти (РТС) 28 за ежегодното публикуване от страна на инвестиционните посредници на идентификационни данни на местата за изпълнение, както и на информацията относно качеството на изпълнение**а) Информация относно водещите пет места за изпълнение на нареждания и постигнатото качество на изпълнение: С изключение на сделки за финансиране с ценни книжа (СФЦК)**

Инвестиционните посредници публикуват водещите по отношение на обемите на търговията пет места за изпълнение за всички изпълнени нареждания на клиенти в зависимост от класа финансови инструменти (с отделни образци за непрофесионални клиенти и за професионални клиенти):

- Клас на финансовия инструмент
- Наименование и идентификационен номер на мястото
- Обем на нарежданията на клиенти, изпълнени на съответното място за изпълнение, изразен като процент от общия изпълнен обем
- Брой на нарежданията на клиенти, изпълнени на съответното място за изпълнение, изразен като процент от общия брой на изпълнените нареждания
- Процент на изпълнените нареждания, които са били „пасивни“ и „агресивни“ нареждания
- Процент на нарежданията, които са били „насочени“ нареждания
- Потвърждение за това дали посредникът е изпълнявал средно по-малко от една сделка на работен ден през предходната година (за съответния клас финансови инструменти)

„Пасивно нареждане“ – нареждане, вписано в дневника за нареждания, което е осигурило ликвидност

„Агресивно нареждане“ – нареждане, вписано в дневника за нареждания, което е изтеглило ликвидност

„Насочено нареждане“ – нареждане, при което конкретното място за изпълнение се определя от клиента преди изпълнението на нареждането

б) Информация относно водещите пет места за изпълнение на нареждания и постигнатото качество на изпълнение: СФЦК

Инвестиционните посредници публикуват водещите пет места за изпълнение по отношение на обемите на търговията за всички изпълнени нареждания на клиенти по СФЦК за класа финансови инструменти, която включва:

- Обем на нарежданията на клиенти, изпълнени на съответното място за изпълнение, изразен като процент от общия изпълнен обем
- Брой на нарежданията на клиенти, изпълнени на съответното място за изпълнение, изразен като процент от общия брой на изпълнените нареждания
- Потвърждение за това дали инвестиционният посредник е изпълнявал средно по-малко от една сделка на работен ден през предходната година (за съответния клас финансови инструменти)

в) Информация относно водещите пет места за изпълнение на нареждания и постигнатото качество на изпълнение

Инвестиционните посредници публикуват за всеки клас финансови инструменти обобщение на анализа и заключенията, които правят от своя подробен мониторинг на качеството на изпълнението на нарежданията, постигнато за всички нареждания на клиенти. Информацията включва:

- Обяснение на относителното значение, което посредникът е отдал на факторите на изпълнението като цена, разходи, скорост, вероятността за изпълнение на нареждането или всяко друго съображение.
- Описание на всякакви тесни връзки, конфликти на интереси и обща собственост по отношение на което и да било от използваните места за изпълнение.
- Обяснение на всякакви специални договорености с всички места за изпълнение по отношение на извършените или получените плащания, отстъпки, намаления или получени непарични облаги.
- Описание на факторите, които са довели до промяна в списъка на местата за изпълнение, включени в политиката на посредника за изпълнение.
- Обяснение на това как начинът на изпълнение на нареждането се различава в зависимост от категоризацията на клиентите.
- Обяснение дали други критерии са били предпочетени пред непосредствената цена и разходите при изпълнение на нареждания на непрофесионални клиенти.
- Обяснение на начина, по който инвестиционният посредник е използвал всички данни или средства, свързани с качеството на изпълнение.
- Обяснение на начина, по който инвестиционният посредник е използвал резултатите на консолидиран доставчик на данни

г) Класове финансови инструменти

- Капиталови инструменти - акции и депозитарни разписки
- Дългови инструменти: (i) Облигации (ii) Инструменти на паричния пазар
- Деривати върху лихвени проценти
- Кредитни деривати
- Валутни деривати
- Структурирани финансови инструменти
- Капиталови деривати
- Секюритизирани деривати
- Стокови деривати и деривати за квоти за емисии
- Договори за разлика
- Борсово търгувани продукти (борсово търгувани фондове, борсово търгувани облигации и борсово търгувани стоки)
- Квоти за емисии
- Други инструменти

д) Образци за отчитане

Table 1

Class of Instrument					
Notification if <1 average trade per business day in the previous year	Y / N				
Top five execution venues ranked in terms of trading volumes (descending order)	Proportion of volume traded as a percentage of total in that class	Proportion of orders executed as percentage of total in that class	Percentage of passive orders	Percentage of aggressive orders	Percentage of directed orders
Name and Venue Identifier (MIC or LEI)					
Name and Venue identifier (MIC or LEI)					
Name and venue identifier (MIC or LEI)					
Name and venue identifier (MIC or LEI)					
Name and venue identifier (MIC or LEI)					

Table 2

Class of Instrument					
Notification if <1 average trade per business day in the previous year	Y / N				
Top five execution venues ranked in terms of trading volumes (descending order)	Proportion of volume traded as a percentage of total in that class	Proportion of orders executed as percentage of total in that class	Percentage of passive orders	Percentage of aggressive orders	Percentage of directed orders
Name and Venue Identifier(MIC or LEI)					
Name and Venue identifier(MIC or LEI)					
Name and venue identifier(MIC or LEI)					
Name and venue identifier(MIC or LEI)					
Name and venue identifier(MIC or LEI)					