



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 8. Juni 2016
(OR. en)

10065/16
ADD 1

EF 181
ECOFIN 586
DELECT 109

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	8. Juni 2016
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2016) 3333 final ANNEX 1
Betr.:	ANHANG zur DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom XXX zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards bezüglich der Daten, die Ausführungsplätze zur Qualität der Ausführung von Geschäften veröffentlichen müssen

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 3333 final ANNEX 1.

Anl.: C(2016) 3333 final ANNEX 1



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 8.6.2016
C(2016) 3333 final

ANNEX 1

ANHANG

zur

DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom XXX

zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards bezüglich der Daten, die Ausführungsplätze zur Qualität der Ausführung von Geschäften veröffentlichen müssen

ANHANG

Tabelle 1: Gemäß Artikel 3 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben – Art des Ausführungsplatzes

Platz	Bezeichnung	Kennung (ISO 10383 Marktidentifikationscode (MIC) oder Rechtsträgerkennung (LEI))	
Land der zuständigen Behörde	Bezeichnung		
Marktsegment	Bezeichnung	Kennung (ISO 10383 Marktsegment MIC)	
Datum des Handelstags	ISO 8601		
Ausfälle	Art	Anzahl	Durchschnittsdauer
Terminierte Auktion	Art	Anzahl	Durchschnittsdauer
Fehlgeschlagene Geschäfte		Anzahl	Wert (in % des Gesamtwerts der an diesem Tag ausgeführten Geschäfte)

Tabelle 2: Gemäß Artikel 3 Absatz 2 zu veröffentlichende Angaben – Art des Finanzinstruments

Finanzinstrument	Bezeichnung	Kennung (ISO 6166)
Schriftliche Beschreibung des Finanzinstruments, wenn keine Kennung vorhanden (einschließlich Währung des/der zugrundeliegenden Instruments, Preismultiplikators, Preis- und Mengennotierung sowie Zustellart)		
Klassifizierung des Instruments	(ISO 10962 CFI-Code)	
Währung	(ISO 4217)	

Tabelle 3: Gemäß Artikel 4 Buchstabe a zu veröffentlichende Angaben

Zeit (T)	Größenbereich	Alle durchgeführten Geschäfte in den ersten zwei Minuten nach Zeit T		Erstes Geschäft nach Zeit T (wenn keine Geschäfte in den ersten zwei Minuten nach Zeit T)									
		Einfacher, durchschnittlich ausgeführter Preis (ausschließlich Provisionen und aufgelaufene Zinsen)	Ausgeführter Gesamtwert	Preis	Ausführungszeit	Geschäftsgröße	Handels-system	Handels-modus	Handels-plattform	bestes Gebot und Angebot oder geeigneter Referenzwert zur Ausführungszeit			
09:30:00	1												
	2												
	3												
11:30:00	1												
	2												
	3												
13:30:00	1												
	2												
	3												
15:30:00	1												
	2												
	3												

Tabelle 4: Gemäß Artikel 4 Buchstabe b zu veröffentlichende Angaben

einfacher, durchschnittlicher Geschäftspreis	
Volumen-gewichteter Geschäftspreis	
ausgeführter Höchstpreis	
ausgeführter Niedrigstpreis	

Tabelle 5: Gemäß Artikel 5 zu veröffentlichende Kostenangaben

In Artikel 5 Buchstaben a bis d verlangte Angaben	(Beschreibung)
Verknüpfung zu einer Website oder einer anderen Quelle, auf der weitere Kostenangaben erhältlich sind	
Gesamtwert aller Rabatte, Preisnachlässe oder anderen angebotenen Zahlungen (%-Satz des Gesamthandelswerts während des Berichtszeitraums)	%
Gesamtwert aller Kosten (in % des Gesamthandelswerts während des Berichtszeitraumvolumens)	%

Tabelle 6: Gemäß Artikel 6 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit

Anzahl der zugegangenen Order oder Angebotsanfragen	
Anzahl durchgeführter Geschäfte	
Gesamtwert durchgeführter Geschäfte	
Anzahl der zugegangenen stornierten oder zurückgezogenen Order oder Angebotsanfragen	
Anzahl der zugegangenen abgeänderten Order oder Angebotsanfragen	
Mediane Geschäftsgröße	
Mediane Größe aller Order oder Angebotsanfragen	
Anzahl der ausgewiesenen Marktmacher	

Tabelle 7: Gemäß Artikel 7 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit

Zeit	Bester Gebotspreis	Bester Angebotspreise	Gebotsgröße	Angebotsgröße	Buchtiefe bei 3 Preiserhöhungen
09:30:00					
11:30:00					

13:30:00					
15:30:00					

Tabelle 8: Gemäß Artikel 7 Absätze 2 und 3 zu veröffentlichende Angaben

Durchschnittliche effektive Bandbreite	
Durchschnittsvolumen bei bestem Gebot und Angebot	
Durchschnittliche Bandbreite bei bestem Gebot und Angebot	
Anzahl der Stornierungen bei bestem Gebot und Angebot	
Anzahl der Änderungen bei bestem Gebot und Angebot	
Durchschnittliche Buchtiefe bei 3 Preiserhöhungen	
Verstrichene mittlere Zeit (auf die Millisekunde genau) zwischen einer aggressiven Order oder Angebotsannahme, die dem Ausführungsplatz zugeht, und die anschließende Komplett- oder Teilausführung	
Verstrichene mediane Zeit (auf die Millisekunde genau) zwischen einem Bestens-Auftrag, der dem Ausführungsplatz zugeht, und die anschließende Komplett- oder Teilausführung	
Durchschnittsgeschwindigkeit bei der Ausführung nicht abgeänderter passiver Order bei bestem Gebot und Angebot	
Anzahl der fehlgeschlagenen Fill-or-Kill-Aufträge	
Anzahl der unverzüglichen oder stornierten Order mit Nullauffüllung	
Anzahl der am Handelsplatz durchgeführten Geschäfte, die laut Artikel 4 oder 9 der EU-Verordnung Nr. 600/2014 ein großes Volumen umfassen	
Wert der am Handelsplatz durchgeführten Geschäfte, die gemäß der Artikel 4 oder 9 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 ein großes Volumen umfassen	
Anzahl der Geschäfte, die gemäß der Artikel 4 oder 9 MiFIR am Handelsplatz durchgeführt wurden, mit Ausnahme von Ordnern, die in einem System für Ordermanagement der anhängigen Bekanntgabe des Handelsplatzes geführt werden und kein großes Volumen umfassen	
Wert der Geschäfte, die gemäß der Artikel 4	

oder 9 MiFIR am Handelsplatz durchgeführt wurden, mit Ausnahme von Ordnern, die in einem System für Ordermanagement der anhängigen Bekanntgabe des Handelsplatzes geführt werden und kein großes Volumen umfassen	
Anzahl der Handelsunterbrechungen	
Durchschnittsdauer der Handelsunterbrechungen	
Anzahl der Aussetzungen	
Art der Aussetzungen	
Durchschnittsdauer der Aussetzungen	
Für fortlaufende Angebotsplätze: Anzahl der Zeiträume, während derer keine Angebote bereitgestellt wurden	
Für fortlaufende Angebotsplätze: Durchschnittsdauer der Zeiträume, während derer keine Angebote bereitgestellt wurden	
Durchschnittliche Angebotspräsenz	

Tabelle 9: Gemäß Artikel 8 zu veröffentlichende Angaben

Verstrichene mittlere Zeit zwischen Annahme und Ausführung	
Verstrichene mediane Zeit zwischen Annahme und Ausführung	
Verstrichene mittlere Zeit zwischen Anfrage und Bereitstellung entsprechender Angebote	
Verstrichene mediane Zeit zwischen Anfrage und Bereitstellung entsprechender Angebote	