



VPRAŠALNIK ZA SKRBNI PREGLED ZA OBSTOJEČE IN NOVE ČLANE LJUBLJANSKE BORZE D. D., LJUBLJANA, ZA NAMEN 7. ČLENA DELEGIRANE UREDBE KOMISIJE (EU) 2017/584

(Obr. 09/MT)

Podatki o članu

Firma družbe:

LEI koda:

Pravna oblika družbe (prosimo, označite). Potrjujemo, da je družba registrirana kot:

- investicijska družba

- kreditna institucija

- družba evropskega gospodarskega prostora, ki ne deluje po MiFID

- družba zunaj evropskega gospodarskega prostora

Klirinško razmerje (prosimo, označite):

- poravnalni član

- neporavnalni član

Trgovalna koda člana:

Naslov družbe:

Sedež in naslov družbe:

Telefon:

Faks:

Elektronski naslov:

Kontaktne podatke (prosimo vnesite ime in priimek, naziv, telefon in elektronski naslov):

Vodja skladnosti:

Vodja trgovanja:



VPRAŠALNIK ZA SKRBNI PREGLED

1. Kontrole pred trgovanjem

Skladno s 15. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 so člani zavezani k uporabi kontrol pred trgovanjem.

Ali uporabljate kontrole pred trgovanjem? DA NE

Če jih uporabljate, označite, katere kontrole uporabljate.

- cenovne ovratnice, ki avtomatično blokirajo ali prekličejo naročila, ki ne izpolnjujejo določenih cenovnih parametrov

- omejitev maksimalne vrednosti naročila

- omejitev maksimalne količine naročila

- omejitve največjega števila sporočil, ki preprečijo pošiljanje prekomernega števila sporočil (vnos, sprememba ali preklic naročila) v knjigo naročil.

2. Kontrole po trgovanju

Skladno s 17. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 so člani zavezani k uporabi kontrol po trgovanju.

Ali uporabljate kontrole po trgovanju? DA NE

Če jih uporabljate, jih prosim podrobno opišite.

3. Algoritemsko trgovanje

Ali imate vzpostavljeno algoritemsko trgovanje? DA NE



Če imate vzpostavljeno algoritemsko trgovanje, odgovorite tudi na spodnja vprašanja:

3.1. Usposobljenost zaposlenih

Skladno s 3. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 so člani zavezani k zagotavljanju ustreznega števila kadrov, usposobljenih za upravljanje sistemov za algoritemsko trgovanje in algoritmov za trgovanje.

Prosimo potrdite, da zagotavljate ustrezno število usposobljenih kadrov skladno z zahtevami 3. člena Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 DA NE

3.2. Preverjanje skladnosti

Skladno s 6. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 so člani zavezani k testiranju skladnosti svojih sistemov za algoritemsko trgovanje in algoritmov za trgovanje.

Prosimo potrdite, da izvajate tehnično in funkcionalno preverjanje skladnosti v skladu z veljavnimi pravili, kot so navedena v prvem odstavku 6. člena Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589. DA NE

Navedite, katera oseba / osebe bodo pooblaščenec za potrditev preverjanja skladnosti, kot je to obdobje potrebno (prosimo upoštevajte, da bodo sprejete samo Izjave o skladnosti preskusov pripravljenosti, ki jih podpišejo spodaj naštetih oseb):

Preverjanje skladnosti (prosimo vnesite ime in priimek, naziv, telefon in elektronski naslov):

Pooblaščenec oseba 1

Pooblaščenec oseba 2

Pooblaščenec oseba 3

3.3. Mehanizem za izklop v sili

Skladno z 12. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 so člani zavezani imeti vzpostavljen mehanizem za izklop v sili.

Prosimo potrdite, da lahko kadarkoli uporabite mehanizem za izklop v sili za preklic neizvedenih naročil v skladu z 12. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 in da imate vzpostavljeno politiko uporabe mehanizma za izklop v sili: DA NE



4. Neposredni dostop do trga (DMA) in Sistem za usmerjanje naročil (ORS)

Prosimo označite, ali zagotavljate neposredni dostop do trga (DMA)¹, kot je opredeljeno v 41. točki prvega odstavka 4. člena MiFID II in 20. člena Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/565: DA NE

Če zagotavljate DMA, odgovorite tudi na spodnja vprašanja:

4.1. Prosimo potrdite skladnost z določbami pravil in navodil Ljubljanske borze ter 22. členom Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/589 pri zagotavljanju neposrednega dostopa do trga: DA NE

4.2. Katere sisteme in postopke imate vzpostavljene za spremljanje, filtriranje in nadzor naročil in poslov vaših DMA strank in katera merila uporabljate v ta namen?

4.3. Prosimo opišite svoj proces skrbnega pregleda DMA strank, s poudarkom na začetnem pregledu in tekočem spremljanju:

4.4. Prosimo opišite mehanizme, ki podpirajo urejeno zagotavljanje pretoka k borzi (zaustavitev naročil, preprečevanje fiktivnih poslov, odkrivanje tržnih manipulacij) in kako vplivajo na pretok naročil?

¹ **Neposredni dostop do trga (DMA)** pomeni dogovor, v kateri član ali udeleženec ali stranka mesta trgovanja dovoljuje osebi, da uporabi svojo trgovalno kodo, tako da lahko oseba elektronsko posreduje naročila, ki se nanašajo na finančni instrument, neposredno mestu trgovanja, ko ta oseba uporablja infrastrukturo člana ali udeleženca ali odjemalca ali katerega koli sistema za povezovanje, ki ga zagotovi član ali udeleženec ali odjemalec, za posredovanje naročil. Šteje se, da oseba ni zmožna elektronskega prenosa naročil, ki se nanašajo na finančni instrument, neposredno mestu trgovanja: kadar ta oseba ne more sama opredeliti točnega delčka sekunde, v katerem se vnese naročilo, ter obdobja veljavnosti naročila v tem časovnem okviru ali kadar takšen neposredni elektronski prenos naročil poteka prek ureditev za optimizacijo postopkov izvršitve naročil, ki določajo druge parametre naročila, kot je mesto ali mesta, na katera bi bilo treba poslati naročilo, razen če so te ureditve vgrajene v sisteme stranke in ne v sisteme člana ali udeleženca na reguliranem trgu ali v MTF oziroma stranke v OTF.



4.5. Prosimo označite, ali uporabljate Sistem za usmerjanje naročil (Order Routing System – ORS): DA NE

5. Poročanje v skladu s 26. členom MiFIR

Prosimo označite ali ste dolžni poročati o transakcijah v skladu s prvim odstavkom 26. člena MiFIR: DA NE²

6. Uskladitev poslovnih ur v skladu s 378. členom ZTFI-1 in Delegirano uredbo Komisije (EU) 2017/574.

Prosimo označite ali imate poslovne ure v svojih zalednih sistemih, s katerimi beležite datume in čas, ki jih uporabljate za poročanje posameznih dejstev, ki jih zahtevajo predpisi, usklajene z poslovnimi urami trgovalnega sistema: DA NE

7. Skladnost z določbami določb ZTFI-1 ali ZBan-2, ki se uporabljajo za člane borze

Izjavljamo, da poznamo in spoštujemo določbe ZTFI-1 ali ZBan-2, ki se uporabljajo za člane borze in da:

- ni dejstev, ki bi postavila pod vprašaj zahtevano zanesljivost člana za udeležbo pri borznem trgovanju;
- ne obstajajo okoliščine, ki bi omejevale sposobnost člana za izvajanje poslovnih transakcij, zlasti zaradi insolventnosti; to velja tudi v primeru podobnih okoliščin zunaj države;
- član ali eden od njegovih zakonitih zastopnikov ali pooblaščenih oseb ni bil obsojen s strani sodišča zaradi kaznivega dejanja zoper premoženje, gospodarstvo ali pravni promet, ali izven države obsojen za kaznivo dejanje, ki se po teh določbah lahko šteje za enakovredno;
- ni dejstev, ki bi lahko škodovala ugledu, pravilnemu trgovanju ali poštenosti trgovanja domačih trgov.

DA NE

² Smo predmet 5. točke 26. člena MiFIR.



Potrdujemo, da so določbe ZTFI-1 izpolnjene za vse osebe, ki so sprejete kot borzni trgovci člana trgovanja. Izrecno potrdujemo, da v zvezi z osebami, imenovanimi kot borzni trgovci:

- ni znanih dejstev, ki bi lahko nakazovala, da prosilec ni tako zanesljiv, kot se zahteva, da bi lahko sodeloval pri trgovanju na borzi;
- ne obstajajo okoliščine, ki bi omejevale njihovo sposobnost opravljanja poslovnih transakcij, zlasti zaradi insolventnosti; to velja tudi v primeru podobnih okoliščin, ki lahko veljajo zunaj države;
- niso bili obsojeni s strani sodišča zaradi kaznivega dejanja zoper premoženje, gospodarstvo ali pravni promet, ali izven države za kaznivo dejanje, ki se po teh določbah lahko šteje za enakovredno;
- ni dejstev, ki bi lahko škodovala ugledu, pravilnemu trgovanju ali poštenosti trgovanja na domačih

DA NE

Izjavljamo, da se zavedamo, da moramo Ljubljansko borzo takoj obvestiti o kakršnih koli okoliščinah, zaradi katerih zgornja zagotovila ne morejo biti več v skladu z dejstvi in predložiti dokaze o navedenem, zlasti nerešenih kot tudi pravnomočnih sodnih in upravnih postopkih proti nam in / ali proti našim pooblaščenecem, zakonitim zastopnikom in borznim trgovcem. Ljubljanska borza si pridržuje pravico, da kadar koli preveri izpolnjevanje zahtev za sprejem člana borze in zahteva ustrezne informacije od člana borze.

DA NE

Zavedamo se in soglašamo, da smo pri delovanju na borznem trgu Ljubljanske borze in trgu SI ENTER zavezani z določbami aktov Ljubljanske borze ter ostalimi pravili nacionalne in evropske zakonodaje.

DA NE

Z vračilom tega vprašalnika potrdujemo, da so vse informacije in izjave v tem dokumentu podane pravilno in v celoti.

(datum, kraj)

pravno zavezujoči podpis predstavnika člana (z natisnjenim imenom in žigom podjetja)

Prosimo, da nam skeniran izpolnjen vprašalnik pošljete na elektronski naslov: upravljanje-trgov@ljse.si ali po pošti na naslov: Ljubljanska borza, d. d., Ljubljana, Slovenska cesta 56, 1000 Ljubljana.