

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2017/580**ze dne 24. června 2016,****kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro uchovávání příslušných údajů o pokynech týkajících se finančních nástrojů****(Text s významem pro EHP)**

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a zejména na čl. 25 odst. 3 čtvrtý pododstavec uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Organizátoři obchodních systémů by měli mít možnost sami si stanovit způsob, jak budou záznamy údajů o veškerých pokynech týkajících se finančních nástrojů uchovávat. Aby však bylo možné příslušné údaje o pokynech efektivně a účelně shromažďovat, srovnávat a analyzovat pro účely monitorování trhu, měly by se dané informace příslušným orgánům na jejich žádost poskytovat v jednotných standardech a formátech v souladu s čl. 25 odst. 2 nařízení (EU) č. 600/2014.
- (2) V zájmu srozumitelnosti a právní jistoty, a aby se zamezilo dvojímu ukládání týchž údajů, mělo by se toto nařízení vztahovat na všechny datové prvky týkající se pokynů, včetně podrobností, jež se mají hlásit v souladu s čl. 26 odst. 1 a 3.
- (3) Aby mohly příslušné orgány efektivně odhalovat a vyšetřovat možné zneužívání trhu nebo pokusy o zneužití trhu, potřebují rychle identifikovat osoby, jež mohly být do procesu spojeného s daným pokynem významně zapojeny, včetně členů či účastníků obchodních systémů, subjektů odpovědných za investiční rozhodnutí a rozhodování o provedení pokynů, makléřů neprovádějících pokyny a zákazníků, na jejichž účet jsou pokyny vydávány. Organizátoři obchodních systémů by proto měli uchovávat informace umožňující identifikaci těchto osob.
- (4) Aby mohly příslušné orgány efektivně odhalovat podezřelé vzorce potenciálně nekorrektního jednání určitého zákazníka, včetně situací, kdy zákazník jedná prostřednictvím několika investičních podniků, měli by organizátoři obchodních systémů zaznamenávat totožnost zákazníků, na jejichž účet jejich členové či účastníci pokyn zadali. Organizátoři by měli takové zákazníky označovat pomocí jedinečných identifikačních označení a umožnit tak jednoznačnou a účinnou identifikaci těchto osob a tím i efektivnější analýzu možného zneužívání trhu, na němž by se zákazníci mohli podílet.
- (5) Organizátoři obchodních systémů by neměli mít povinnost zaznamenávat identifikační označení všech zákazníků v řetězci, nýbrž pouze těch zákazníků, na jejichž účet člen nebo účastník obchodního systému pokyn zadal.
- (6) Identifikace strategií tvorby trhu či podobných činností je důležitá pro efektivní odhalování manipulace s trhem. Příslušné orgány mohou díky ní rozlišit tok pokynů pocházející z investičního podniku jednajícího podle podmínek předem stanovených emitentem nástroje, kterého se pokyn týká, nebo obchodním systémem, do něhož byl pokyn zadán, od toku pokynů pocházejícího z investičního podniku jednajícího dle vlastního uvážení nebo uvážení klienta.
- (7) Měly by se uchovávat záznamy o přesném datu a čase a o podrobnostech zadání každého pokynu, jeho úpravy, zrušení, zamítnutí a provedení. Umožňuje to sledovat změny pokynu během jeho životnosti, které mohou být důležité pro odhalení a posouzení možné manipulace s trhem a přednostního obchodování (front running).

⁽¹⁾ Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84.

- (8) Aby se zajistilo, že obraz knihy pokynů daného obchodního systému bude přesný a úplný, vyžadují příslušné orgány informace o burzovních dnech, v nichž se finanční nástroje obchodují. Tyto informace lze použít zejména ke stanovení začátku a konce aukčního období či kontinuálního obchodování a k zjištění, zda pokyny nezpůsobují neplánované přerušení obchodování. Také jsou nezbytné k tomu, aby se zjistilo, jak budou pokyny vzájemně reagovat, zvláště končí-li burzovní dny v náhodných okamžicích jako aukce. Při analýze možné manipulace aukce by mohly být nápomocny také informace o orientačních cenách a objemech stanovených spárováním pokynů. Jelikož jediný pokyn může ovlivnit aukční cenu po spárování, objem aukce po spárování nebo obojí, potřebují příslušné orgány vědět, jaký vliv na tyto hodnoty jednotlivé pokyny mají. Zjistit, který pokyn tyto hodnoty ovlivnil, by bez těchto informací bylo těžké. Kromě toho by každé relevantní události mělo být přiřazeno pořadové číslo, aby v okamžiku, kdy probíhají dvě či více událostí najednou, bylo možné určit jejich pořadí.
- (9) Stanovení pozice jednotlivých pokynů v knize pokynů umožňuje knihu pokynů rekonstruovat a analyzovat pořadí, v jakém byly pokyny provedeny, což je důležitou součástí dohledu, jehož účelem je bránit zneužívání trhu. Pozice se jednotlivým pokynům přiřazují podle toho, jak jsou v obchodním systému nastaveny priority. Organizátoři obchodních systémů by proto měli pokynům přiřazovat prioritu a zaznamenávat ji, a sice prioritu cena–viditelnost–čas nebo objem–čas.
- (10) K účinnému sledování trhu je nutné, aby bylo možné spojit pokyny s příslušnými obchody. Organizátoři obchodních systémů by proto měli používat u obchodů specifické identifikační kódy spojující pokyny s příslušnými obchody.
- (11) Organizátoři obchodních systémů by měli u každého obdrženého pokynu vést záznamy o jeho typu a souvisejících konkrétních instrukcích, které společně určují, jak bude pokyn jejich systémem pro párování zpracován, a to v souladu s jejich vlastní klasifikací. Tyto podrobné informace mají zásadní význam pro to, aby příslušné orgány mohly v rámci dohledu, jehož účelem je bránit zneužívání trhu, sledovat obchodní činnost v knize pokynů daného obchodního systému, a zejména replikovat chování jednotlivých pokynů v rámci knihy pokynů. Vzhledem k široké škále existujících a potenciálních nových typů pokynů vytvářených organizátory obchodních systémů a specifickým technickým vlastnostem systémů však uchovávání těchto podrobných informací v souladu s interními klasifikačními systémy organizátorů v současnosti nemusí příslušným orgánům umožňovat, aby replikovaly činnost v knihách pokynů všech obchodních systémů konzistentním způsobem. Proto, aby příslušné orgány byly schopny všechny pokyny v knize pokynů přesně lokalizovat, měli by organizátoři obchodních systémů klasifikovat každý obdržený pokyn také podle toho, jedná-li se o limitní pokyn, který je obchodovatelný, nebo o stop pokyn, který je obchodovatelný, pouze když je na trhu uskutečněn obchod za předem stanovenou cenu.
- (12) V zájmu konzistentnosti a k zajištění hladkého fungování finančních trhů je nezbytné, aby se ustanovení tohoto nařízení a ustanovení nařízení (EU) č. 600/2014 použila od stejného data.
- (13) Toto nařízení vychází z návrhu regulačních technických norem, jež Komisi předložil Evropský orgán pro cenné papíry a trhy (ESMA).
- (14) Orgán ESMA uspořádal k návrhu regulačních technických norem, z něhož toto nařízení vychází, otevřené veřejné konzultace, analyzoval potenciální související náklady a přínosy a vyžádal si stanovisko skupiny subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízené článkem 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010⁽¹⁾,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Rozsah, normy a formát příslušných údajů o pokynech

1. Organizátoři obchodních systémů uchovávají k dispozici pro příslušný orgán údaje týkající se všech pokynů sdělovaných prostřednictvím jejich systémů uvedené v člancích 2 až 13 tak, jak je uvedeno ve druhém a třetím sloupci tabulky 2 v příloze, a v rozsahu, v jakém se týkají daného pokynu.

⁽¹⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Jestliže si příslušný orgán vyžádá kterýkoliv z údajů uvedených v článku 1 v souladu s čl. 25 odst. 2 nařízení (EU) č. 600/2014, poskytne mu jej organizátor obchodního systému za použití norem a ve formátu, jež jsou předepsány ve čtvrtém sloupci tabulky 2 v příloze tohoto nařízení.

Článek 2

Identifikace příslušných stran

1. Organizátoři obchodních systémů vedou o každém pokynu tyto záznamy:
 - a) identifikace člena nebo účastníka obchodního systému, který pokyn do obchodního systému zadal, tak jak je uvedeno v kolonce 1 tabulky 2 v příloze;
 - b) identifikace osoby nebo počítačového algoritmu člena nebo účastníka obchodního systému, do něhož byl pokyn zadán, který je odpovědný za investiční rozhodnutí související s daným pokynem, tak jak je uvedeno v kolonce 4 tabulky 2 v příloze;
 - c) identifikace osoby nebo počítačového algoritmu člena nebo účastníka obchodního systému, který je odpovědný za provedení daného pokynu, tak jak je uvedeno v kolonce 5 tabulky 2 v příloze;
 - d) identifikace člena nebo účastníka obchodního systému, který pokyn směřoval jménem a na účet jiného člena nebo účastníka obchodního systému, jakožto makléře neprovádějícího pokyny, tak jak je uvedeno v kolonce 6 tabulky 2 v příloze;
 - e) identifikace zákazníka, na jehož účet člen nebo účastník obchodního systému pokyn do obchodního systému zadal, tak jak je uvedeno v kolonce 3 tabulky 2 v příloze.
2. Jestliže je člen, účastník nebo zákazník obchodního systému podle právních předpisů členského státu oprávněn pokyn poté, co byl zadán do obchodního systému, alokovat svému zákazníkovi a jestliže jej svému zákazníkovi nealokoval již v okamžiku zadání pokynu, identifikuje se pokyn tak, jak je uvedeno v kolonce 3 tabulky 2 přílohy.
3. Zadává-li se do obchodního systému několik pokynů najednou ve formě souhrnného pokynu, identifikuje se souhrnný pokyn tak, jak je uvedeno v kolonce 3 tabulky 2 přílohy.

Článek 3

Postavení členů nebo účastníků obchodního systému a poskytování likvidity

1. Postavení, v jakém člen nebo účastník obchodního systému zadává pokyn, se popíše tak, jak je uvedeno v kolonce 7 tabulky 2 v příloze.
2. Následující pokyny se identifikují tak, jak je uvedeno v kolonce 8 tabulky 2 v příloze:
 - a) pokyny zadané do obchodního systému členem nebo účastníkem v rámci strategie tvorby trhu podle článků 17 a 48 směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU⁽¹⁾;
 - b) pokyny zadané do obchodního systému členem nebo účastníkem v rámci jakékoliv jiné činnosti představující poskytování likvidity prováděné podle podmínek předem stanovených emitentem nástroje, kterého se pokyn týká, nebo obchodním systémem.

⁽¹⁾ Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně směrnic 2002/92/ES a 2011/61/EU (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

Článek 4

Zaznamenávání data a času

1. Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o datu a čase, kdy nastala kterákoliv z událostí uvedených v kolonce 21 tabulky 2 v příloze tohoto nařízení, s přesností stanovenou v článku 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 ⁽¹⁾, jak je uvedeno v kolonce 9 tabulky 2 přílohy tohoto nařízení. S výjimkou data a času zamítnutí pokynu obchodním systémem se všechny události uvedené v kolonce 21 tabulky 2 v příloze tohoto nařízení zaznamenávají s použitím obchodních hodin systému pro párování v obchodním systému.
2. Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o datu a čase u všech datových prvků uvedených v kolonce 49, 50 a 51 tabulky 2 v příloze tohoto nařízení s přesností stanovenou v článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574.

Článek 5

Doba platnosti a omezení pokynů

1. Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o době platnosti a omezeních pokynů uvedených v kolonce 10 a 11 tabulky 2 v příloze.
2. Záznamy data a času týkající se doby platnosti se vedou tak, jak je uvedeno v kolonce 12 tabulky 2 v příloze.

Článek 6

Priorita a pořadová čísla

1. Organizátoři obchodních systémů provozujících systémy obchodování na základě priority cena–viditelnost–čas vedou záznamy o časovém razítku priority všech pokynů, jak je uvedeno v kolonce 13 tabulky 2 v příloze. Časové razítko priority je nastaveno s přesností stanovenou v čl. 4 odst. 1.
2. Organizátoři obchodních systémů provozujících systémy obchodování na základě priority objem–čas vedou záznamy o množstvích, jež určují prioritu pokynů, tak jak je uvedeno v kolonce 14 tabulky 2 v příloze, a záznamy o časovém razítku priority podle odstavce 1.
3. Organizátoři obchodních systémů, kteří používají kombinaci priority cena–viditelnost–čas a priority objem–čas a pokyny ve své knize pokynů zobrazují podle časové priority, se řídí ustanoveními odstavce 1.
4. Organizátoři obchodních systémů, kteří používají kombinaci priority cena–viditelnost–čas a priority objem–čas a pokyny ve své knize pokynů zobrazují podle priority objem–čas, se řídí ustanoveními odstavce 2.
5. Organizátoři obchodních systémů přiřadí každé události pořadové číslo, tak jak je uvedeno v kolonce 15 tabulky 2 v příloze.

Článek 7

Identifikační kódy pokynů týkajících se finančních nástrojů

1. Organizátoři obchodních systémů přiřadí každému pokynu individuální identifikační kód, tak jak je uvedeno v kolonce 20 tabulky 2 v příloze. Identifikační kód je jedinečný pro každou knihu pokynů, obchodní den a finanční nástroj. Platí od okamžiku, kdy organizátor obchodního systému přijme pokyn, až do odstranění pokynu z knihy pokynů. Identifikační kód platí i pro zamítnuté pokyny, bez ohledu na důvod jejich zamítnutí.

⁽¹⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 ze dne 7. června 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o regulační technické normy týkající se míry přesnosti obchodních hodin (viz strana 148 v tomto čísle Úředního věstníku).

2. Organizátor obchodního systému zaznamenává podrobnosti o strategických pokynech s implikovanou funkcionalitou (SOIF), které se poskytují veřejnosti, jak je uvedeno v příloze. V kolonce 33 tabulky 2 v příloze je zahrnuto prohlášení, že se jedná o implicitní pokyn.

Po provedení pokynu SOIF o něm organizátor obchodního systému uchovává podrobnosti, jak je uvedeno v příloze.

Po provedení pokynu SOIF se uvede identifikační kód pokynu odkazující k dané strategii, který bude stejný pro všechny pokyny, jež s danou strategií souvisí. Identifikační kód podle strategie je upřesněn v kolonce 46 tabulky 2 v příloze.

3. Pokyn zadaný do obchodního systému a umožňující použití strategie směrování obchodní systém při jeho směrování do jiného obchodního systému označí jako „směrovaný“ (routed), jak je uvedeno v kolonce 33 tabulky 2 v příloze. Pokynu zadanému do obchodního systému a umožňujícímu použití strategie směrování zůstává po celou dobu životnosti tentýž identifikační kód, bez ohledu na to, zda je zbývající množství do knihy pokynů zadáno znovu, či nikoli.

Článek 8

Události mající vliv na pokyny týkající se finančních nástrojů

Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o podrobnostech týkajících se nových pokynů, jak je uvedeno v kolonce 21 tabulky 2 v příloze.

Článek 9

Typy pokynů týkajících se finančních nástrojů

1. Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o typu každého jednotlivého pokynu, který obdrží, dle vlastní klasifikace, jak je uvedeno v kolonce 22 tabulky 2 v příloze.

2. Organizátoři obchodních systémů klasifikují každý pokyn, který obdrží, buď jako limitní pokyn, nebo jako stop pokyn, jak je uvedeno v kolonce 23 tabulky 2 v příloze.

Článek 10

Ceny související s pokyny

Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o všech podrobnostech týkajících se cen, jež souvisejí s pokyny, jak je uvedeno v oddílu I tabulky 2 v příloze.

Článek 11

Instrukce týkající se pokynů

Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o všech instrukcích, jež obdrží k jednotlivým pokynům, jak je uvedeno v oddílu J tabulky 2 v příloze.

Článek 12

Identifikační kód obchodů v obchodním systému

Organizátoři obchodních systémů přiřadí každému obchodu, který je výsledkem částečného nebo úplného provedení pokynu, samostatný identifikační kód, tak jak je uvedeno v kolonce 48 tabulky 2 v příloze.

Článek 13

Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem

1. Organizátoři obchodních systémů vedou záznamy o podrobnostech jednotlivých pokynů, tak jak je uvedeno v oddílu K tabulky 2 v příloze.
2. Jestliže si příslušné orgány vyžádají podrobnosti uvedené v oddílu K dle článku 1, má se za to, že se žádost týká rovněž podrobností souvisejících s pokynem uvedených v kolonce 9 a v kolonkách 15 až 18 tabulky 2 v příloze.

Článek 14

Vstup v platnost a použitelnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Použije se od data uvedeného v článku 55 druhém pododstavci nařízení (EU) č. 600/2014.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 24. června 2016.

Za Komisi
předseda
Jean-Claude JUNCKER

PŘÍLOHA

Tabulka 1

Legenda k tabulce 2

| SYMBOL | DRUH ÚDAJŮ | DEFINICE |
|--------------------|--|---|
| {ALPHANUM-n} | Až n alfanumerických znaků | Volný text |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 alfanumerické znaky | Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217 |
| {DATE_TIME_FORMAT} | Formát data a času podle ISO 8601 | Datum a čas v následujícím formátu: RRRR-MM-DDThh:mm:ss.dddddZ. — „RRRR“ představuje rok; — „MM“ měsíc; — „DD“ den; — „T“ znamená, že se má použít písmeno „T“ (time/čas) — „hh“ představuje hodinu; — „mm“ minutu; — „ss.ddddd“ představuje sekundu a zlomek sekundy; — Z je čas UTC (koordinovaný světový čas). Data a časy se uvádějí v UTC. |
| {DATEFORMAT} | Formát data podle ISO 8601 | Formátování dat: RRRR-MM-DD |
| {DECIMAL-n/m} | Celkem až nmístné desetinné číslo, z toho až m míst mohou být zlomky | Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. — desetinný oddělovač je „.“ (tečka); — před zápornými čísly je znaménko „-“ (minus); — hodnoty jsou zaokrouhleny a nezkráceny. |
| {INTEGER-n} | Celé číslo celkem až nmístné | Numerické pole pro kladné i záporné celé hodnoty. |
| {ISIN} | 12 alfanumerických znaků | Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166 |
| {LEI} | 20 alfanumerických znaků | Identifikátor právnické osoby ve smyslu normy ISO 17442 |
| {MIC} | 4 alfanumerické znaky | Identifikátor trhu ve smyslu normy ISO 10383 |
| {NATIONAL_ID} | 35 alfanumerických znaků | Identifikátor odpovídá identifikátoru uvedenému v článku 6 a příloze II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ⁽¹⁾ |

(1) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům (viz strana 449 v tomto čísle Úředního věstníku).

Tabulka 2

Údaje o pokynech

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|---|--|---|---|
| Oddíl A – Identifikace příslušných stran | | | |
| 1 | Identifikace subjektu, který pokyn zadal | Totožnost člena či účastníka obchodního systému. U přímého elektronického přístupu (DEA) totožnost poskytovatele DEA | {LEI} |
| 2 | Přímý elektronický přístup (DEA) | „ano“, pokud byl pokyn do obchodního systému zadán pomocí DEA definovaného v čl. 4 odst. 1 bodě 41 směrnice 2014/65/EU „ne“, pokud pokyn nebyl do obchodního systému zadán pomocí DEA definovaného v čl. 4 odst. 1 bodě 41 směrnice (EU) 2014/65/EU | „ano“ „ne“ |
| 3 | Identifikační kód zákazníka | Kód používaný k identifikaci zákazníka člena či účastníka obchodního systému. Existuje-li přímý elektronický přístup (DEA), použije se kód uživatele DEA. Je-li zákazníkem právnická osoba, použije se kód LEI zákazníka. Není-li zákazníkem právnická osoba, použije se {NATIONAL_ID}. U souhrnných pokynů se použije štítek AGGR podle čl. 2 odst. 3 tohoto nařízení. U dosud nealokovaných pokynů se použije štítek PNAL podle čl. 2 odst. 2 tohoto nařízení. Tato kolonka zůstane prázdná, pouze pokud člen nebo účastník obchodního systému nemá žádného zákazníka. | {LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR“ – souhrnné pokyny „PNAL“ – nealokované pokyny |
| 4 | Investiční rozhodnutí v rámci podniku | Kód používaný k identifikaci osoby nebo algoritmu člena nebo účastníka obchodního systému, který je odpovědný za investiční rozhodnutí v souladu s článkem 8 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Je-li za investiční rozhodnutí člena nebo účastníka obchodního systému odpovědná fyzická osoba nebo osoby, označí se odpovědná osoba nebo osoba nesoucí primární odpovědnost pomocí {NATIONAL_ID}. Je-li za investiční rozhodnutí odpovědný algoritmus, vyplní se kolonka dle článku 8 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Jestliže investiční rozhodnutí nebylo přijato osobou nebo algoritmem člena nebo účastníka obchodního systému, ponechá se tato kolonka prázdná. | {NATIONAL_ID} – fyzické osoby {ALPHANUM-50} – algoritmy |
| 5 | Provedení obchodu v rámci podniku | Kód používaný k identifikaci osoby nebo algoritmu člena nebo účastníka obchodního systému, který je odpovědný za provedení obchodu na základě daného pokynu v souladu s článkem 9 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Je-li za provedení obchodu odpovědná fyzická osoba, označí se {NATIONAL_ID}. | {NATIONAL_ID} – fyzické osoby {ALPHANUM-50} – algoritmy |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|-----------------------------|---|--|
| | | <p>Je-li za provedení obchodu odpovědný algoritmus, vyplní se tato kolonka dle článku 9 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.</p> <p>Je-li do provedení obchodu zapojeno více osob nebo osoby spolu s algoritmy, určí člen, účastník nebo zákazník obchodního systému obchodníka nebo algoritmus, který nese primární odpovědnost dle čl. 9 odst. 4 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 a do této kolonky zaneše jeho totožnost.</p> | |
| 6 | Makléř neprovádějící pokyny | <p>V souladu s čl. 2 písm. d).</p> <p>Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná.</p> | {LEI} |

Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity

| | | | |
|---|-----------------------|---|---|
| 7 | Postavení | <p>Uvádí, zda byl pokyn zadán v rámci obchodování člena nebo účastníka obchodního systému párováním pokynů na vlastní účet podle čl. 4 odst. 1 bodu 38 směrnice 2014/65/EU nebo na vlastní účet podle čl. 4 odst. 1 bodu 6 směrnice 2014/65/EU.</p> <p>Pokud nebyl pokyn zadán v rámci obchodování člena nebo účastníka obchodního systému párováním pokynů na vlastní účet nebo jeho obchodování na vlastní účet, uvede se v kolonce, že obchod se uskutečnil na základě jiného postavení.</p> | <p>„DEAL“ – Obchodování na vlastní účet</p> <p>„MTCH“ – Párování pokynů na vlastní účet</p> <p>„AOTC“ – Jakékoli jiné postavení</p> |
| 8 | Poskytování likvidity | Uvádí, zda byl pokyn do obchodního systému zadán v rámci strategie tvorby trhu podle článků 17 a 48 směrnice 2014/65/EU nebo v rámci jiné činnosti dle článku 3 tohoto nařízení. | <p>„ano“</p> <p>„ne“</p> |

Oddíl C – Datum a čas

| | | | |
|---|-------------|---|--|
| 9 | Datum a čas | Datum a čas každé z událostí uvedených v oddílu [G] a [K] | <p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Počet číslic po „sekundách“ se stanoví podle článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574.</p> |
|---|-------------|---|--|

Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů

| | | | |
|----|----------------|--|--|
| 10 | Doba platnosti | <p>Good-For-Day (Platnost jeden den): pokyn je platný v den obchodování, jeho platnost končí ke konci obchodního dne, v němž byl zadán do knihy pokynů.</p> <p>Good-Till-Cancelled (Platnost do zrušení): pokyn zůstane v knize pokynů aktivní a realizovatelný až do okamžiku, kdy bude zrušen.</p> | <p>„DAVY“ – Good-For-Day</p> <p>„GTCV“ – Good-Till-Cancelled</p> |
|----|----------------|--|--|

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|----------------|---|---|
| | | <p>Good-Till-Time (Platnost do okamžiku): pokyn je platný nejpozději do předem stanoveného okamžiku stávajícího burzovního dne.</p> <p>Good-Till-Date (Platnost do data): pokyn je platný do konce dne předem specifikovaného data.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time (Platnost do data a okamžiku): pokyn platný do předem specifikovaného data a času.</p> <p>Good After Time (Platnost od okamžiku): pokyn je aktivní až od předem stanoveného okamžiku stávajícího burzovního dne.</p> <p>Good After Date (Platnost od data): pokyn je aktivní až od začátku předem stanoveného data.</p> <p>Good After Specified Date and Time (Platnost od data a okamžiku): pokyn je aktivní až od předem stanoveného okamžiku předem stanoveného data.</p> <p>Immediate-Or-Cancel (Ihned nebo zruš): pokyn se provede v okamžiku zadání do knihy pokynů (realizovatelné množství) a jeho zbylá část (v případě částečné realizace), která nebyla realizována, v knize pokynů nezůstává.</p> <p>Fill-Or-Kill (Splň nebo zruš): pokyn se provede v okamžiku zadání do knihy pokynů za předpokladu, že jej lze splnit celý; pokud jej lze provést jen částečně, automaticky se zamítne a nelze jej provést.</p> <p>Ostatní: jakékoliv další označení specifické pro určité obchodní modely, platformy nebo systémy.</p> | <p>„GTTV“ – Good-Till-Time</p> <p>„GTDV“ – Good-Till-Date</p> <p>„GTSV“ – Good-Till-Specified Date and Time</p> <p>„GATV“ – Good After Time</p> <p>„GADV“ – Good After Date</p> <p>„GASV“ – Good After Specified Date and Time</p> <p>„IOCV“ – Immediate-Or-Cancel</p> <p>„FOKV“ – Fill-Or-Kill nebo {ALPHANUM-4} znaky, které ještě obchodní systém pro svou klasifikaci nepoužívá</p> |
| 11 | Omezení pokynů | <p>Good For Closing Price Crossing Session (Platnost pro uzavírací aukci): pokud pokyn splňuje podmínky uzavírací aukce.</p> <p>Valid For Auction (Platnost pro aukci): pokyn je aktivní a lze jej realizovat pouze během aukce (což může předem stanovit člen nebo účastník obchodního systému, který pokyn zadal, např. úvodní nebo závěrečná aukce nebo aukce v rámci dne).</p> <p>Valid For Continuous Trading only (Platnost pro kontinuální obchodování): pokyn je aktivní pouze po dobu kontinuálního obchodování.</p> | <p>„SESR“ – Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>„VFAR“ – Valid For Auction</p> <p>„VFCR“ – Valid For Continuous Trading only</p> |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|----------------------------|--|---|
| | | Ostatní: jakékoliv další označení specifické pro určité obchodní modely, platformy nebo systémy. | {ALPHANUM-4} znaky, které ještě obchodní systém pro svou klasifikaci nepoužívá Platí-li několik typů, zaneše se do této kolonky několik štítků oddělených čárkami. |
| 12 | Datum a čas doby platnosti | Toto se vztahuje na časové razítko udávající čas, kdy se pokyn stává aktivním nebo je definitivně odstraněn z knihy pokynů. Good for day (Platnost jeden den): datum zadání s nastavením časového razítka těsně před půlnocí. Good till time (Platnost do okamžiku): datum zadání a čas uvedený v pokynu. Good till date (Platnost do data): datum konce platnosti s nastavením časového razítka těsně před půlnocí. Good till specified date and time (Platnost do data a okamžiku): stanovené datum a čas konce platnosti. Good after time (Platnost od okamžiku): datum zadání a stanovený čas, kdy se pokyn stává aktivním. Good after date (Platnost od data): stanovené datum s nastavením časového razítka těsně po půlnoci. Good after specified date and time (Platnost od data a okamžiku): stanovené datum a čas, kdy se pokyn stává aktivním. Good till cancelled (Platnost do zrušení): konečné datum a čas, kdy je pokyn automaticky vyrazen z tržních operací. Ostatní: časové razítko jakéhokoliv dalšího typu platnosti. | {DATE_TIME_FORMAT} Počet číslic po „sekundách“ se stanoví podle článku nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. |

Oddíl E – Priorita a pořadové číslo

| | | | |
|----|-------------------------|--|---|
| 13 | Časové razítko priority | Pokaždé, když se priorita pokynu změní, se tato kolonka aktualizuje. | {DATE_TIME_FORMAT} Počet číslic po „sekundách“ se stanoví podle článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. |
| 14 | Objemová priorita | U obchodních systémů používajících prioritu objem–čas bude v této kolonce kladný číselný údaj odpovídající množství. Pokaždé, když se priorita pokynu změní, se tato kolonka aktualizuje. | Až 20 kladných numerických znaků. |
| 15 | Pořadové číslo | Ke každé z událostí uvedených v oddílu G se přiřadí celá kladná hodnota ve vzestupném pořadí. Pořadové číslo každého typu události je jedinečné, konzistentní u všech událostí, které organizátor obchodního systému označí časovým razítkem, a platné pro celý den, v němž k události došlo. | {INTEGER-50} |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|---------|---|--|
|----|---------|---|--|

Oddíl F – Identifikace pokynu

| | | | |
|----|---------------------------------------|--|---------------|
| 16 | Kód MIC segmentu | Identifikace obchodního systému, v němž byl pokyn zadán. Používá-li obchodní systém MIC segmentu, použije se MIC segmentu. Nepoužívá-li obchodní systém MIC segmentu, použije se operační MIC. | {MIC} |
| 17 | Kód knihy pokynů | Alfanumerický kód stanovený obchodním systémem pro každou knihu pokynů. | {ALPHANUM-20} |
| 18 | Identifikační kód finančního nástroje | Jedinečný a nezaměnitelný identifikátor finančního nástroje | {ISIN} |
| 19 | Datum přijetí | Datum přijetí původního pokynu | {DATEFORMAT} |
| 20 | Identifikační kód pokynu | Alfanumerický kód přidělený danému pokynu organizátorem obchodního systému. | {ALPHANUM-50} |

Oddíl G – Události mající vliv na pokyn

| | | | |
|----|--|--|---|
| 21 | Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu | <p>Nový pokyn: přijetí nového pokynu organizátorem obchodního systému.</p> <p>Spuštěný pokyn: pokyn, který se stává proveditelným, nebo neproveditelným v závislosti na splnění předem stanovené podmínky.</p> <p>Pokyn nahrazen členem či účastníkem obchodního systému: jestliže se člen, účastník nebo zákazník obchodního systému rozhodl z vlastního podnětu změnit některý z charakteristických rysů pokynu, který předtím zadal do knihy pokynů.</p> <p>Pokyn nahrazen tržní operací (automaticky): jestliže byl některý z charakteristických rysů pokynu změněn počítačovým systémem organizátora obchodního systému. Včetně případů, kdy dojde ke změně stávajícího charakteru pokynu peg nebo trailing stop, aby odrážel jeho umístění v knize pokynů.</p> <p>Pokyn nahrazen tržní operací (lidským zásahem): jestliže byl některý z charakteristických rysů pokynu změněn někým z personálu organizátora obchodního systému. Včetně případů, kdy má člen, účastník nebo zákazník obchodního systému problém s výpočetní technikou a potřebuje okamžitě zrušit své pokyny.</p> <p>Změna stavu z podnětu člena či účastníka obchodního systému. Zahrnuje aktivaci a deaktivaci.</p> | <p>„NEWO“ – New order – Nový pokyn</p> <p>„TRIG“ – Triggered – Spuštěný pokyn</p> <p>„REME“ – Replaced by the member or participant of the trading venue – Pokyn nahrazen členem či účastníkem obchodního systému</p> <p>„REMA“ – Replaced by market operations (automatic) – Pokyn nahrazen tržní operací (automaticky)</p> <p>„REMH“ – Replaced by market operations (human intervention) – Pokyn nahrazen tržní operací (lidským zásahem)</p> <p>„CHME“ – Change of status at the initiative of the member or participant of the trading venue – Změna stavu z podnětu člena či účastníka obchodního systému</p> |
|----|--|--|---|

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|---------|---|--|
| | | <p>Změna stavu v důsledku tržních operací.</p> <p>Pokyn zrušen z podnětu člena či účastníka obchodního systému, jestliže se člen, účastník nebo zákazník rozhodne z vlastního podnětu zrušit pokyn, který předtím zadal.</p> <p>Pokyn zrušen tržní operací. Zahrnuje ochranný mechanismus pro investiční podniky provádějící tvorbu trhu podle článků 17 a 48 směrnice 2014/65/EU.</p> <p>Zamítnutý pokyn: pokyn, který organizátor obchodního systému přijal, avšak zamítl.</p> <p>Pokyn s uplynulou platností: pokyn, který je po uplynutí platnosti odstraněn z knihy pokynů.</p> <p>Částečně splněný pokyn: pokyn nebyl splněn celý a část množství zbývá splnit.</p> <p>Splněný pokyn: nezbývá nic ke splnění.</p> | <p>„CHMO“ – Change of status due to market operations – Změna stavu v důsledku tržních operací</p> <p>„CAME“ – Cancelled at the initiative of the member or participant of the trading venue – Pokyn zrušen z podnětu člena či účastníka obchodního systému</p> <p>„CAMO“ – Cancelled by market operations – Pokyn zrušen tržní operací</p> <p>„REMO“ – Rejected order – Zamítnutý pokyn</p> <p>„EXPI“ – Expired order – Pokyn s uplynulou platností</p> <p>„PARF“ – Partially filled – Částečně splněný pokyn</p> <p>„FILL“ – Filled – Splněný pokyn {ALPHANUM-4} znaky, které ještě obchodní systém pro svou klasifikaci nepoužívá</p> |

Oddíl H – Typ pokynu

| | | | |
|----|-------------------------|---|--------------------------------------|
| 22 | Typ pokynu | Označuje typ pokynu zadaného do obchodního systému podle specifikací obchodního systému. | {ALPHANUM-50} |
| 23 | Klasifikace typu pokynu | <p>Klasifikace pokynu podle dvou generických typů pokynu. LLIMITNÍ pokyn: v případech, kdy je pokyn obchodovatelný,</p> <p>a</p> <p>STOP pokyn: v případech, kdy je pokyn obchodovatelný, pouze když se na trhu uskuteční obchod za předem stanovenou cenu.</p> | „LMTO“ pro limitní a „STOP“ pro stop |

Oddíl I – Ceny

| | | | |
|----|--------------|---|---|
| 24 | Limitní cena | <p>Nejvyšší nákupní nebo nejnižší prodejní cena, za kterou může být pokyn realizován.</p> <p>Rozpětí ceny strategického pokynu. Může být kladné nebo záporné.</p> | <p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v jednotkách hlavní měny.</p> |
|----|--------------|---|---|

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|--|---|---|
| | | <p>U pokynů bez limitní ceny nebo u pokynů bez stanovené ceny zůstane tato kolonka prázdná.</p> <p>U konvertibilních dluhopisů bude v této kolonce reálná cena (hrubá neboli <i>dirty price</i> nebo čistá neboli <i>clean price</i>) použitá pro daný pokyn.</p> | <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech.</p> |
| 25 | Další limitní cena | Jakákoliv další limitní cena platná pro daný pokyn. Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná. | <p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v hlavní měně.</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech.</p> |
| 26 | Stop cena (Stop price) | <p>Cena, která musí být dosažena, aby se pokyn aktivoval.</p> <p>U stop pokynů aktivovaných událostmi nezávislými na ceně finančního nástroje bude v této kolonce stop cena rovna nule.</p> <p>Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná.</p> | <p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v hlavní měně.</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech.</p> |
| 27 | Vázaná limitní cena (Pegged limit price) | <p>Nejvyšší nákupní nebo nejnižší prodejní cena, za kterou může být vázaný pokyn realizován.</p> <p>Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná.</p> | <p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v hlavní měně.</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech.</p> |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|-----------------------------|--|---|
| 28 | Cena obchodu | <p>Cena, za kterou se obchod realizoval, bez případné provize a úroku.</p> <p>U opčních smluv jde o prémii z derivátové smlouvy na podkladový nástroj nebo indexový bod.</p> <p>U sázek na spready jde o referenční cenu přímého podkladového nástroje.</p> <p>U swapů úvěrového selhání (CDS) jde o kupón v bazických bodech.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v jednotkách hlavní měny.</p> <p>Je-li cena irelevantní, uvede se do kolonky „NOAP“.</p> | <p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou.</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech.</p> <p>„NOAP“</p> |
| 29 | Měna, v níž je uvedena cena | Měna, v níž je cena obchodu pro finanční nástroj související s pokynem vyjádřena (pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou). | {CURRENCYCODE_3} |
| 30 | Měna komponenty 2 | <p>V případě swapů více měn nebo křížových měnových swapů měna, v níž je denominována komponenta 2 smlouvy.</p> <p>U swapcí, jejichž podkladový swap tvoří více měn, měna, v níž je denominována komponenta 2 swapu.</p> <p>Tato kolonka se vyplní pouze u smluv o úrokových a měnových derivátech.</p> | {CURRENCYCODE_3} |
| 31 | Cenová notace | Uvádí, zda je cena vyjádřena v peněžní hodnotě, procentuálním podílem, výnosem nebo v bazických bodech. | <p>„MONE“ – Peněžní hodnota</p> <p>„PERC“ – Procentní podíl</p> <p>„YIEL“ – Výnos</p> <p>„BAPO“ – Bazické body</p> |

Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů

| | | | |
|----|--------------------------|---|---|
| 32 | Indikátor nákupu/prodeje | <p>Označuje, zda se jedná o pokyn koupit, nebo prodat.</p> <p>U opcí a swapcí je kupující protistranou, která má právo uplatnit opci, a prodávající protistranou, která opci prodává a získává prémii.</p> <p>U futures a forwardů, které se netýkají měny, je kupující protistranou, která kupuje nástroj, a prodávající protistranou, která nástroj prodává.</p> <p>U swapů týkajících se cenných papírů je kupující protistranou, která nese riziko pohybu ceny podkladového cenného papíru a získává částku jistiny. Prodávající je protistranou, která hradí částku jistiny.</p> | <p>„BUYI“ – koupit</p> <p>„SELL“ – prodat</p> |
|----|--------------------------|---|---|

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|-------------|--|--|
| | | <p>U swapů týkajících se úrokových sazeb nebo inflačních indexů je kupující protistranou, která platí pevnou sazbu. Prodávající je protistranou, která inkasuje pevnou sazbu. U bazických úrokových swapů (s proměnlivými sazbami) je kupující protistranou, která hradí rozpětí, a prodávající je protistranou, která inkasuje rozpětí.</p> <p>U měnových swapů a forwardů a křížových měnových swapů je kupující protistranou, která získává měnu první v abecedním pořadí dle normy ISO 4217, a prodávající protistranou, která tuto měnu dodá.</p> <p>U dividendových swapů je kupující protistranou, která získává ekvivalentní skutečnou výplatu dividend. Proávající je protistranou, která vyplácí dividendu a inkasuje pevnou sazbu.</p> <p>U derivátových nástrojů pro převod úvěrového rizika s výjimkou opcí a swapů je kupující protistranou, která pořizuje zajištění. Proávající je protistranou, která zajištění prodává.</p> <p>U derivátových smluv na komoditu nebo emisní povolenky je kupující protistranou, která získává komoditu nebo emisní povolenku specifikovanou ve zprávě, a prodávající je protistranou, která komoditu nebo emisní povolenku dodává.</p> <p>U dohod o budoucí úrokové sazbě je kupující protistranou, která hradí pevnou sazbu, a prodávající je protistranou, která inkasuje pevnou sazbu.</p> <p>V případě navýšení pomyslné hodnoty je kupující totožný s nabyvatelem finančního nástroje z původní transakce a prodávající je totožný s převodcem finančního nástroje z původní transakce.</p> <p>V případě snížení pomyslné hodnoty je kupující totožný s převodcem finančního nástroje z původní transakce a prodávající je totožný s nabyvatelem finančního nástroje z původní transakce.</p> | |
| 33 | Stav pokynu | <p>Označuje, zda je pokyn aktivní/neaktivní/pozastavený, pevný/indikativní (přirazuje se pouze kotacím)/implicitní/směrovaný.</p> <p>Aktivní – obchodovatelný pokyn s výjimkou kotací.</p> <p>Neaktivní – neobchodovatelný pokyn s výjimkou kotací.</p> <p>Pevný/indikativní – přirazuje se pouze kotacím. Indikativní kotace znamená, že je viditelná, ale nelze ji realizovat. Zahnuje opční listy v některých obchodních systémech. Pevné kotace lze realizovat.</p> <p>Implicitní – používá se u strategických pokynů odvozených od funkce „implied in“ a „implied out“.</p> <p>Směrovaný – používá se pro pokyny směrované obchodním systémem do jiného obchodního systému.</p> | <p>„ACTI“ – aktivní nebo „INAC“ – neaktivní nebo „FIRM“ – pevná kotace nebo „INDI“ – indikativní kotace nebo „IMPL“ – implikovaný strategický pokyn nebo „ROUT“ – směrovaný pokyn</p> <p>Platí-li několik stavů, zanesse se do této kolonky několik štítků oddělených čárkami.</p> |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|-----------------------------------|---|---|
| 34 | Množstevní notace | Označuje, zda je uvedené množství vyjádřeno počtem jednotek, nominální hodnotou, nebo peněžní hodnotou. | „UNIT“ – Počet jednotek „NOML“ – Nominální hodnota „MONE“ – Peněžní hodnota |
| 35 | Měna množství | Měna, v níž je množství vyjádřeno. Vyplní se, pouze pokud je množství vyjádřeno nominální nebo peněžní hodnotou. | {CURRENCYCODE_3} |
| 36 | Původní množství | Počet jednotek finančního nástroje nebo počet derivátových smluv v pokynu. Nominální nebo peněžní hodnota finančního nástroje. U sázek na spready je množství peněžní hodnota vsazená na pohyb bodů v podkladovém finančním nástroji. V případě navýšení nebo snížení pomyslné hodnoty derivátových smluv číslo odpovídá absolutní hodnotě změny a je vyjádřeno jako kladné číslo. U swapů úvěrového selhání odpovídá množství pomyslné hodnotě, na kterou se nabyté nebo převedené zajištění vztahuje. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |
| 37 | Zbývající a skryté množství | Celkové množství, které zbývá v knize pokynů po částečném provedení pokynu nebo jiné události, která na něj měla vliv. V případě pokynu k částečnému splnění je toto objem zbývající po částečném provedení. Při zadání pokynu se rovná počátečnímu množství. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |
| 38 | Zobrazované množství | Množství viditelné (jako opak skrytého) v knize pokynů. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |
| 39 | Obchodované množství | V případě částečného nebo úplného provedení se v této kolonce uvede realizované množství. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |
| 40 | Minimální akceptovatelné množství | Minimální akceptovatelné množství, aby byl pokyn splněn, přičemž pokyn může zahrnovat několik částečných provedení. Normálně se týká pouze jiných typů pokynů než trvalých. Je-li irrelevantní, zůstane tato kolonka prázdná. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|----|--|--|---|
| 41 | Minimální proveditelné množství | Minimální velikost jakéhokoliv potenciálního provedení. Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná. | {DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek. {DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou. |
| 42 | Minimální proveditelné množství při prvním provedení | Upřesňuje, zda se minimální proveditelné množství týká pouze prvního provedení. Je-li kolonka 41 prázdná, může i tato kolonka zůstat prázdná. | „ano“ „ne“ |
| 43 | Indikátor pasivního pokynu | Ukazuje, zda je pokyn do obchodního systému zadán s příznakem/štítkem, podle něhož nebude neprodleně proveden proti případnému viditelnému pokynu v opačném směru. | „ano“ „ne“ |
| 44 | Indikátor pasivního nebo agresivního pokynu | Při částečném splnění nebo splnění pokynu ukazuje, zda pokyn již byl v knize pokynů a poskytl likviditu (pasivní), nebo inicioval obchod a tedy odebral likviditu (agresivní). Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná. | „PASV“ – pasivní „AGRE“ – agresivní |
| 45 | Ochrana před samostatným automatickým provedením | Označuje, zda byl pokyn zadán s kritérii znemožňujícími jeho samostatné automatické provedení oproti pokynu na opačné straně knihy pokynů vloženému týměž členem nebo účastníkem. | „ano“ „ne“ |
| 46 | Identifikační kód podle strategie | Alfanumerický kód použitý k propojení všech souvisejících pokynů, které jsou součástí strategie podle čl. 7 odst. 2. | {ALPHANUM-50} |
| 47 | Strategie směřování | Strategie směřování podle specifikace obchodního systému. Je-li irelevantní, zůstane tato kolonka prázdná. | {ALPHANUM-50} |
| 48 | Identifikační kód obchodů v obchodním systému | Alfanumerický kód přidělený danému obchodu obchodním systémem podle článku 12 tohoto nařízení. Identifikační kód obchodu v obchodním systému musí být jedinečný, konzistentní a trvalý pro každý MIC segmentu dle ISO10383 a obchodní den. Pokud obchodní systém nepoužívá MIC segmentu, identifikační kód obchodu v obchodním systému musí být jedinečný, konzistentní a trvalý pro každý operační MIC a obchodní den. Z komponent identifikačního kódu obchodu nesmí být patrná totožnost protistran daného obchodu. | {ALPHANUM-52} |

| Č. | Kolonka | Údaje o pokynech, jež mají být k dispozici příslušným orgánům | Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost |
|--|------------------------|--|---|
| Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem | | | |
| 49 | Fáze obchodování | Název každé z fází obchodování, během nichž je pokyn v knize pokynů, včetně zastavení, přerušení a pozastavení obchodování. | {ALPHANUM-50} |
| 50 | Orientační aukční cena | Cena finančního nástroje, ohledně kterého byl zadán jeden či více pokynů, při níž v aukci dojde ke spárování. | <p>{DECIMAL-18/5} pokud je cena vyjádřena peněžní nebo nominální hodnotou.</p> <p>Je-li cena nahlášena jako peněžní hodnota, uvede se v jednotkách hlavní měny.</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem.</p> |
| 51 | Orientační objem aukce | Objem (počet jednotek finančního nástroje), který lze realizovat za orientační aukční cenu v kolonce 50, pokud aukce skončila přesně v daný okamžik. | <p>{DECIMAL-18/17} pokud je množství vyjádřeno počtem jednotek.</p> <p>{DECIMAL-18/5} pokud je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou.</p> |