

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2017/580**af 24. juni 2016****om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for registrering af relevante oplysninger om ordrer vedrørende finansielle instrumenter****(EØS-relevant tekst)**

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 (⁽¹⁾), særlig artikel 25, stk. 3, fjerde afsnit, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) Operatørerne af markedspladser bør frit kunne vælge, hvordan de fører fortegnelser over relevante oplysninger om alle ordrer vedrørende finansielle instrumenter. For at muliggøre effektiv sortering, sammenligning og analyse af de relevante oplysninger om ordrer med henblik på markedsovervågning bør sådanne oplysninger dog stilles til rådighed for de kompetente myndigheder under anvendelse af ensartede standarder og formater, når en kompetent myndighed anmoder om sådanne oplysninger i henhold til artikel 25, stk. 2, i forordning (EU) nr. 600/2014.
- (2) For at sikre klarheden og retssikkerheden og undgå dobbelt opbevaring af de samme oplysninger bør denne forordning omfatte alle dataelementer vedrørende ordrer, herunder oplysninger, der skal indberettes i henhold til artikel 26, stk. 1 og 3.
- (3) For at muliggøre effektiv konstatering og undersøgelse af potentielle tilfælde af eller forsøg på markedsmisbrug er det nødvendigt, at de kompetente myndigheder hurtigt kan identificere personer og enheder, der i væsentlig grad er involveret i ordreprocessen, herunder medlemmer af eller deltagere på markedspladser, enheder, der er ansvarlige for investerings- og udførelsesbeslutninger, ikke-eksekverende mæglere og kunder, på hvis vegne ordrer indledes. Operatørerne af markedspladser bør i den henseende føre fortegnelser over sådanne parter.
- (4) For at sætte de kompetente myndigheder i stand til mere effektivt at identificere mistænkelig adfærd, der kan være udtryk for, at en kunde er involveret i misbrug, herunder tilfælde, hvor kunden opererer gennem en række investeringsselskaber, bør operatørerne af markedspladser registrere identiteten af de kunder, på hvis vegne deres medlemmer eller deltagere afgav ordren. Operatørerne bør identificere de pågældende kunder ved unikke identifikatorer for at lette sikker og effektiv identificering af sådanne personer og derved fremme en mere effektiv analyse af potentielle tilfælde af markedsmisbrug, som kunderne kan være involveret i.
- (5) Det bør ikke kræves, at operatørerne af markedspladser registrerer kundeidentifikatorer for alle kunder i handelskæden, men kun for den kunde, på hvis vegne medlemmet eller deltageren afgav ordren.
- (6) Det er vigtigt at identificere prisstillelsesstrategier eller lignende aktiviteter for at muliggøre effektiv konstatering af markedsmanipulation. Dette gør det muligt for de kompetente myndigheder at sondre mellem ordrestrømmen fra et investeringsselskab, der handler på grundlag af vilkår, der på forhånd er fastsat af udstederen af det instrument, der er genstand for ordren, eller af den markedsplads, som ordren er afgivet til, og ordrestrømmen fra et investeringsselskab, der handler efter på eget initiativ eller på sin kundes initiativ.
- (7) Der bør føres fortegnelser over den præcise dato og det præcise tidspunkt for alle afgivelser, ændringer, annulleringer afvisninger og udførelser af ordrer. Dette giver mulighed for at overvåge ændringerne i ordren gennem dens levetid, hvilket kan have stor betydning for konstateringen og vurderingen af potentielle tilfælde af markedsmanipulation og front running.

⁽¹⁾ EUT L 173 af 12.6.2014, s. 84.

- (8) For at sikre et nøjagtigt og fuldstændigt billede af en markedsplads' ordrebog har de kompetente myndigheder brug for oplysninger om de handelsperioder, hvor der handles finansielle instrumenter. Disse oplysninger kan bl. a. bruges til at vurdere, hvornår auktioner eller løbende handel begynder og slutter, og hvorvidt ordrer forårsager ikke-planlagte handelsafbrydelser. Oplysningerne er også nødvendige for at identificere, hvordan ordrer interagerer, især når perioderne slutter på tilfældige tidspunkter, f.eks. i forbindelse med auktioner. Oplysninger om vejledende uncrossingpriser og -mængder vil også understøtte analysen af mulig auktionsmanipulation. I betragtning af, at en enkelt ordre kan påvirke enten auktionsuncrossingprisen, auktionsuncrossingmængden eller begge, er det nødvendigt, at de kompetente myndigheder ser hver ordres indvirkning på disse værdier. Uden disse oplysninger vil det være vanskeligt at identificere, hvilken ordre der har påvirket værdierne. Ydermere bør hver relevant begivenhed tildeles et sekvensnummer for at bestemme rækkefølgen af begivenheder, når flere begivenheder indtræffer på samme tidspunkt.
- (9) Specificering af ordrenes placering i en ordrebog giver mulighed for at rekonstruere ordrebogen og for at analysere sekvensen af ordreudførelsen, som er et vigtigt element i overvågning af markedsmisbrug. Den placering, en ordre tildeles, afhænger af, hvordan prioriteten bestemmes af handelssystemet. Derfor bør operatørerne af markedspladser tildele og registrere ordrenes prioritet efter prissynlighed-tidsprioritetsmetoden eller størrelse-tidsprioritetsmetoden.
- (10) For at muliggøre effektiv markedsovervågning er det nødvendigt at kunne forbinde ordrer med deres tilsvarende transaktioner. Operatørerne af markedspladser bør derfor have særskilte transaktionsidentifikationskoder, der forbinder ordrer med transaktioner.
- (11) Operatørerne af markedspladser bør for hver modtaget ordre registrere ordretypen og de tilhørende specifikke instrukser, der sammen afgør, hvordan hver ordre skal håndteres af deres matchingmaskiner i overensstemmelse med deres egne klassificeringer. Disse detaljerede oplysninger er afgørende for, at de kompetente myndigheder som led i deres overvågning af markedsmisbrug kan overvåge handelsaktiviteten i en markedsplads' ordrebog og navnlig reproducere, hvordan hver ordre fungerer i ordrebogen. På grund af de mange eksisterende og potentielle nye ordretyper, der udarbejdes af operatørerne af markedspladser, og de specifikke tekniske kendetegn ved sidstnævnte kan registreringen af disse detaljerede oplysninger efter operatørernes interne klassificeringssystem dog vise sig ikke på nuværende tidspunkt at give de kompetente myndigheder mulighed for at reproducere alle markedspladsers ordrebogsaktivitet på en ensartet måde. For at de kompetente myndigheder nøjagtigt kan finde hver ordre i ordrebogen bør operatørerne af markedspladser derfor også klassificere hver modtaget ordre enten som en limiteret ordre, hvis ordren kan udføres, eller som en stopordre, hvis ordren først kan udføres, når en forudbestemt prisbegivenhed indtræffer.
- (12) Af konsekvenshensyn og for at sikre velfungerende finansmarkeder er det nødvendigt, at bestemmelserne i denne forordning og bestemmelserne i forordning (EU) nr. 600/2014 anvendes fra den samme dato.
- (13) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har forelagt Kommissionen.
- (14) ESMA har foretaget åbne offentlige høringer om det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de potentielle omkostninger og fordele i forbindelse hermed samt indhentet en udtalelse fra interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Relevante ordreoplysninger — omfang, standarder og format

1. Operatørerne af markedspladser stiller de oplysninger om hver ordre bekendtgjort gennem deres systemer, som er fastsat i artikel 2-13, til rådighed for deres kompetente myndighed som specificeret i bilagets tabel 2, anden og tredje kolonne, i det omfang de vedrører den pågældende ordre.

⁽¹⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

2. Hvis de kompetente myndigheder anmoder om en eller flere af de i stk. 1 anførte oplysninger i henhold til artikel 25, stk. 2, i forordning (EU) nr. 600/2014, skal operatørerne af markedspladser stille sådanne oplysninger til rådighed under anvendelse af de standarder og formater, der er fastsat i tabel 2, fjerde kolonne, i bilaget til nærværende forordning.

Artikel 2

Identifikation af de relevante parter

1. Operatørerne af markedspladser skal for alle ordrer føre fortegnelser over følgende:
 - a) det medlem af eller den deltager på markedspladsen, der afgav ordren til markedspladsen, identificeret som angivet i tabel 2, felt 1, i bilaget
 - b) den person eller computeralgoritme hos medlemmet af eller deltageren på den markedsplads, hvortil en ordre afgives, som er ansvarlig for investeringsbeslutningen vedrørende ordren, identificeret som angivet i tabel 2, felt 4, i bilaget
 - c) den person eller computeralgoritme hos medlemmet af eller deltageren på markedspladsen, som er ansvarlig for udførelsen af ordren, identificeret som angivet i tabel 2, felt 5, i bilaget
 - d) det medlem af eller den deltager på markedspladsen, der dirigerede ordren på vegne af et andet medlem af eller en anden deltager på markedspladsen og i dennes navn, identificeret som en ikke-eksekverende mægler som angivet i tabel 2, felt 6, i bilaget
 - e) den kunde, på hvis vegne medlemmet af eller deltageren på markedspladsen afgav ordren til markedspladsen, identificeret som angivet i tabel 2, felt 3, i bilaget.
2. Hvis et medlem af eller en deltager eller en kunde på markedsplads i henhold til en medlemsstats lovgivning har tilladelse til at allokere en ordre til sin kunde efter afgivelsen af ordren til markedspladsen og endnu ikke har allokere ordren til kunden på tidspunktet for ordreafgivelsen, skal ordren identificeres som angivet i tabel 2, felt 3, i bilaget.
3. Hvis flere ordrer afgives samlet til markedspladsen som en aggregeret ordre, skal den aggregerede ordre identificeres som angivet i tabel 2, felt 3, i bilaget.

Artikel 3

Handelsegenskab hos medlemmer af eller deltagere på markedspladsen og likviditetstilførselsaktivitet

1. Den handelsegenskab, i medfør af hvilken medlemmet af eller deltageren på markedspladsen afgiver en ordre, beskrives som angivet i tabel 2, felt 7, i bilaget.
2. Følgende ordrer identificeres som angivet i tabel 2, felt 8, i bilaget:
 - a) en ordre afgivet til en markedsplads af et medlem eller en deltager som led i en prisstillelsesstrategi i henhold til artikel 17 og 48 i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU ⁽¹⁾
 - b) en ordre afgivet til en markedsplads af et medlem eller en deltager som led i enhver anden likviditetstilførselsaktivitet, der udføres på grundlag af vilkår, der er fastsat på forhånd enten af udstederen af det instrument, som er genstand for den pågældende ordre, eller af den pågældende markedsplads.

⁽¹⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af direktiv 2002/92/EF og direktiv 2011/61/EU (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 349).

Artikel 4

Registrering af dato og tidspunkt

1. Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over dato og tidspunkt for, hvornår hver af de begivenheder, der er anført i tabel 2, felt 21, i bilaget til nærværende forordning indtraf, med den nøjagtighedsgrad, der er fastsat i artikel 2 i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/574 ⁽¹⁾, som angivet i tabel 2, felt 9, i bilaget til nærværende forordning. Med undtagelse af registreringen af dato og tidspunkt for markedspladssystemers afvisninger af ordrer skal alle begivenheder omhandlet i tabel 2, felt 21, i bilaget til nærværende forordning registreres under anvendelse af de forretningsure, der anvendes af markedspladsernes matchingmaskiner.
2. Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over dato og tidspunkt for hvert af de dataelementer, der er anført i tabel 2, felt 49, 50 og 51, i bilaget til nærværende forordning, med den nøjagtighedsgrad, der er fastsat i artikel 2 i delegeret forordning (EU) 2017/574.

Artikel 5

Gyldighedsperiode og begrænsninger på ordrer

1. Operatører af markedspladser skal føre fortegnelser over de gyldighedsperioder og begrænsninger på ordrer, der er anført i tabel 2, felt 10 og 11, i bilaget.
2. Fortegnelser over datoer og tidspunkt vedrørende gyldighedsperioder skal for hver gyldighedsperiode føres som angivet i tabel 2, felt 12, i bilaget.

Artikel 6

Prioritet og sekvensnummer

1. Operatører af markedspladser, der driver handelssystemer baseret på prissynlighed-tidsprioritet, skal føre fortegnelser over prioritetstidsstempelen for alle ordrer som angivet i tabel 2, felt 13, i bilaget. Prioritetstidsstempelen skal registreres med samme nøjagtighedsgrad som anført i artikel 4, stk. 1.
2. Operatører af markedspladser, der driver handelssystemer baseret på størrelse-tidsprioritet, skal føre fortegnelser over de mængder, der bestemmer ordrenes prioritet, som angivet i tabel 2, felt 14, i bilaget, samt det i stk. 1 omhandlede prioritetstidsstempel.
3. Operatører af markedspladser, der anvender en kombination af prissynlighed-tidsprioritet og størrelse-tidsprioritet og viser ordrer i deres ordrebog efter tidsprioritet, skal overholde stk. 1.
4. Operatører af markedspladser, der anvender en kombination af prissynlighed-tidsprioritet og størrelse-tidsprioritet og viser ordrer i deres ordrebog efter størrelse-tidsprioritet, skal overholde stk. 2.
5. Operatørerne af markedspladser skal tildele hver begivenhed et sekvensnummer og registrere dette, som angivet i tabel 2, felt 15, i bilaget.

Artikel 7

Identifikationskoder for ordrer vedrørende finansielle instrumenter

1. Operatørerne af markedspladser skal tildele hver ordre en individuel identifikationskode som angivet i tabel 2, felt 20, i bilaget. Identifikationskoden skal være unik pr. ordrebog, pr. handelsdag og pr. finansielt instrument. Den skal anvendes fra det tidspunkt, hvor operatøren af markedspladsen har modtaget ordren, indtil ordren fjernes fra ordrebogen. Identifikationskoden skal også anvendes på afviste ordrer uanset årsagen til afvisningen.

⁽¹⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/574 af 7. juni 2016 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for nøjagtighedsgraden for forretningsure (se side 148 idenne EUT).

2. Operatøren af markedspladsen skal føre fortegnelser over de relevante oplysninger om strategiordrer med implicit funktionalitet (strategy orders with implied functionality — SOIF), der formidles til offentligheden som angivet i bilaget. I tabel 2, felt 33, i bilaget skal det angives, at ordren er en implicit ordre.

Ved udførelsen af en SOIF skal oplysningerne om den registreres af operatøren af markedspladsen som angivet i bilaget.

Ved udførelsen af en SOIF skal der angives en identifikationskode for strategiforbundne ordrer under anvendelse af den samme identifikationskode for alle ordrer, der er forbundet med den bestemte strategi. Identifikationskoden for strategiforbundne ordrer opbygges som angivet i tabel 2, felt 46, i bilaget.

3. Ordre, der afgives til en markedsplads med mulighed for en dirigeringsstrategi, skal af den pågældende markedsplads identificeres som »dirigeret« som angivet i tabel 2, felt 33, i bilaget, når de dirigeres til en anden markedsplads. Ordre, der afgives til en markedsplads med mulighed for en dirigeringsstrategi, skal beholde den samme identifikationskode i hele deres levetid, uanset om der genindføres en eventuel resterende mængde i den ordrebog, hvor ordren først blev indført.

Artikel 8

Begivenheder, der påvirker ordre vedrørende finansielle instrumenter

Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over de oplysninger, der er omhandlet i tabel 2, felt 21, vedrørende nye ordre.

Artikel 9

Type af ordre vedrørende finansielle instrumenter

1. Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over ordretype for hver modtaget ordre under anvendelse af deres egen klassificering, som angivet i tabel 2, felt 22, i bilaget.

2. Operatørerne af markedspladser skal klassificere hver modtaget ordre enten som en limiteret ordre eller som en stopordre, som angivet i tabel 2, felt 23, i bilaget.

Artikel 10

Priser vedrørende ordre

Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over alle prisrelaterede oplysninger omhandlet i tabel 2, afsnit I, såfremt de vedrører de pågældende ordre.

Artikel 11

Ordreinstrukser

Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over alle ordreinstrukser, der modtages for hver ordre, som angivet i tabel 2, afsnit J, i bilaget.

Artikel 12

Identifikationskode for markedspladstransaktion

Operatørerne af markedspladser tildeler hver transaktion, der følger af en fuldstændig eller delvis udførelse af en ordre, en individuel transaktionsidentifikationskode som angivet i tabel 2, felt 48, i bilaget.

*Artikel 13***Handelsfaser og vejledende auktionspris og volumen**

1. Operatørerne af markedspladser skal føre fortegnelser over ordreoplysningerne som angivet i tabel 2, afsnit K, i bilaget.
2. Hvis de kompetente myndigheder anmoder om oplysninger omhandlet i afsnit K i henhold til artikel 1, skal de i tabel 2, felt 9 og 15-18, i bilaget indeholdte oplysninger også anses for at være oplysninger vedrørende den ordre, anmodningen drejer sig om.

*Artikel 14***Ikrafttræden og anvendelse**

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Den anvendes fra den dato, der er nævnt i artikel 55, stk. 2, i forordning (EU) nr. 600/2014.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 24. juni 2016.

På Kommissionens vegne

Jean-Claude JUNCKER

Formand

BILAG

Tabel 1

Forklaring til tabel 2

| SYMBOL | DATATYPE | DEFINITION |
|--------------------|--|--|
| {ALPHANUM-n} | Op til n alfanumeriske tegn | Fritekstfelt. |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 alfanumeriske tegn | 3-bogstavvalutakode som defineret i ISO 4217-valutakoder. |
| {DATE_TIME_FORMAT} | ISO 8601 dato- og klokkeslætsformat | Dato og tidspunkt i følgende format: ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ss.dddZ. — »ÅÅÅÅ« er året — »MM« er måneden — »DD« er dagen — »T« — betyder, at bogstavet »T« skal benyttes — »tt« er timetallet — »mm« er minuttallet — »ss.dddZ« er sekunder og brøkdele af sekunder — »Z« er UTC-tid. Datoer og tidspunkter angives i UTC. |
| {DATEFORMAT} | ISO 8601-datoformat | Datoer formateres efter følgende format: ÅÅÅÅ-MM-DD. |
| {DECIMAL-n/m} | Decimaltal på op til n cifre i alt, hvoraf op til m cifre kan være decimaler | Numerisk felt til både positive og negative værdier. — Decimaltegnet er ».« (punktum) — Negative tal har »-« foran (minus). — Værdierne afrundes, trunkeles ikke. |
| {INTEGER-n} | Helt tal med op til n cifre i alt | Numerisk felt til både positive og negative heltalsværdier. |
| {ISIN} | 12 alfanumeriske tegn | ISIN-kode som defineret i ISO 6166. |
| {LEI} | 20 alfanumeriske tegn | Identifikator for juridiske enheder (LEI) som defineret i ISO 17442. |
| {MIC} | 4 alfanumeriske tegn | Markedsidentifikator som defineret i ISO 10383. |
| {NATIONAL_ID} | 35 alfanumeriske tegn | Identifikator fastlagt i artikel 6 og bilag II til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/590 ⁽¹⁾ |

⁽¹⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/590 af 28. juli 2016 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for indberetning af transaktioner til kompetente myndigheder (se side 449 i denne EUT).

Tabel 2

Oplysninger om ordrer

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|---|---|---|---|
| Afsnit A — Identifikation af de relevante parter | | | |
| 1 | Identifikation af den enhed, som afgav ordren | Markedspladsmedlemmets eller -deltagerens identitet. I tilfælde af direkte elektronisk adgang (DEA) oplyses DEA-udbyderens identitet. | {LEI} |
| 2 | Direkte elektronisk adgang (DEA) | »true«, når ordren blev afgivet til markedspladsen via DEA, som defineret i artikel 4,1, nr. 41), i direktiv 2014/65/EU. »false«, når ordren ikke blev afgivet til markedspladsen via DEA, som defineret i artikel 4,1, nr. 41), i direktiv 2014/65/EU. | »true« »false« |
| 3 | Kundeidentifikationskode | Kode, der anvendes til at identificere markedspladsmedlemmets eller -deltagerens kunde. I tilfælde af DEA anvendes DEA-brugerens identitet. Hvis kunden er en juridisk enhed, anvendes kundens LEI-kode. Hvis kunden ikke er en juridisk enhed, anvendes {NATIONAL_ID}. I tilfælde af aggregerede ordrer anvendes mærket AGGR, jf. artikel 2,3, i denne forordning. I tilfælde af allokeringer under behandling anvendes mærket PNAL, jf. artikel 2,2, i denne forordning. Dette felt må kun være tomt, hvis markedspladsmedlemmet eller -deltageren ikke har en kunde. | {LEI} {NATIONAL_ID} »AGGR« — aggregerede ordrer »PNAL« — allokeringer under behandling |
| 4 | Investeringsbeslutning i selskab | Kode, der anvendes til at identificere den person eller algoritme hos medlemmet af eller deltageren på markedspladsen, der er ansvarlig for investeringsbeslutningen, jf. artikel 8 i delegeret forordning (EU) 2017/590. Hvis fysiske personer hos medlemmet af eller deltageren på markedspladsen er ansvarlige for investeringsbeslutningen, skal den person, der er ansvarlig eller har det primære ansvar for investeringsbeslutningen, identificeres under anvendelse af {NATIONAL_ID}. Hvis en algoritme var ansvarlig for investeringsbeslutningen, udfyldes feltet i henhold til artikel 8 i delegeret forordning (EU) 2017/590. Dette felt udfyldes ikke, når investeringsbeslutningen ikke blev truffet af en person eller algoritme hos medlemmet af eller deltageren på markedspladsen. | {NATIONAL_ID} — Fysiske personer {ALPHANUM-50} — Algoritmer |
| 5 | Udførelse i selskab | Kode, der anvendes til at identificere den person eller algoritme hos medlemmet af eller deltageren på markedspladsen, der er ansvarlig for udførelsen af den transaktion, der følger af ordren, jf. artikel 9 i delegeret forordning (EU) 2017/590. Hvis en fysisk person er ansvarlig for udførelsen af transaktionen, identificeres personen under anvendelse af {NATIONAL_ID}. | {NATIONAL_ID} — Fysiske personer {ALPHANUM-50} — Algoritmer |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|--------------------------|--|---|
| | | <p>Hvis en algoritme er ansvarlig for udførelsen af transaktionen, udfyldes feltet i henhold til artikel 9 i delegeret forordning (EU) 2017/590.</p> <p>Hvis mere end en person eller en kombination af personer og algoritmer er involveret i udførelsen af transaktionen, bestemmer medlemmet af eller deltageren eller kunden på markedspladsen, hvilken handler eller algoritme der har hovedansvaret, jf. artikel 9,4, i delegeret forordning (EU) 2017/590, og udfylder dette felt med den pågældende handlers eller algoritmes identitet.</p> | |
| 6 | Ikke-eksekverende mægler | <p>Jf. artikel 2, litra d).</p> <p>Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant.</p> | {LEI} |

Afsnit B — Handelsegenskab og likviditetstilførsel

| | | | |
|---|--------------------------------|--|---|
| 7 | Handelsegenskab | <p>Angivelse af, om ordreafgivelsen opstår som følge af, at medlemmet af eller deltageren på markedspladsen benytter sig af ejermatchingshandel i henhold til artikel 4, nr. 38), i direktiv 2014/65/EU eller handler for egen regning i henhold til nævnte artikel 4, nr. 6), i direktiv 2014/65/EU.</p> <p>Hvis ordreafgivelsen ikke opstår som følge af, at medlemmet af eller deltageren på markedspladsen benytter sig af ejermatchingshandel eller handler for egen regning, skal det angives i feltet, at transaktion blev udført i medfør af en anden egen-skab.</p> | <p>»DEAL« — Handel for egen regning</p> <p>»MTCH« — Ejermatching</p> <p>»OTHR« — Enhver anden egen-skab</p> |
| 8 | Likviditetstilførselsaktivitet | <p>Angivelse af, om en ordre afgives til en markedsplads som led i en prisstillelsesstrategi i henhold til artikel 17 og 48 i direktiv 2014/65/EU eller afgives som led i en anden aktivitet i henhold til denne forordnings artikel 3.</p> | <p>»true«</p> <p>»false«</p> |

Afsnit C — Dato og tidspunkt

| | | | |
|---|-------------------|---|---|
| 9 | Dato og tidspunkt | <p>Datoen og tidspunktet for hver begivenhed, der er angivet i afsnit G og K.</p> | <p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Antallet af cifre efter »sekunder« bestemmes i henhold til artikel 2 i delegeret forordning (EU) 2017/574.</p> |
|---|-------------------|---|---|

Afsnit D — Gyldighedsperiode og begrænsninger på ordrer

| | | | |
|----|-------------------|--|--|
| 10 | Gyldighedsperiode | <p>Good-For-Day: Ordren udløber ved udgangen af den handelsdag, hvor den blev indført i ordrebogen.</p> <p>Good-Till-Cancelled: Ordren forbliver aktiv i ordrebogen og kan udføres, indtil den annulleres.</p> | <p>»DAVY« — Good-For-Day</p> <p>»GTCV« — Good-Till-Cancelled</p> |
|----|-------------------|--|--|

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|----------------------|--|---|
| | | <p>Good-Till-Time: Ordren udløber senest på et forudbestemt tidspunkt inden for handelsperioden.</p> <p>Good-Till-Date: Ordren udløber ved udgangen af en bestemt dato.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time: Ordren udløber på en bestemt dato og et bestemt tidspunkt.</p> <p>Good After Time: Ordren bliver først aktiv efter et forudbestemt tidspunkt inden for handelsperioden.</p> <p>Good After Date: Ordren bliver først aktiv fra begyndelsen af en forudbestemt dato.</p> <p>Good After Specified Date and Time: Ordren bliver først aktiv fra et forudbestemt tidspunkt på en forudbestemt dato.</p> <p>Immediate-Or-Cancel: En ordre, der udføres, når den indføres i ordrebogen (for den mængde, der kan udføres), og som ikke forbliver i ordrebogen for en eventuel resterende mængde, der ikke er blevet udført.</p> <p>Fill-Or-Kill: En ordre, der udføres, når den indføres i ordrebogen, forudsat at den kan udføres fuldt ud. Hvis ordren kun delvist kan udføres, afvises den automatisk og kan derfor ikke udføres.</p> <p>Andet: Alle yderligere angivelser, der er unikke for specifikke forretningsmodeller, handelsplatforme eller -systemer.</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 eller {ALPHANUM-4} tegn, der ikke allerede anvendes i markedspladens egen klassificering.</p> |
| 11 | Begrænsning på ordre | <p>Good For Closing Price Crossing Session: Når en ordre opfylder betingelserne for den afsluttende session, hvor lukkeprisen bestemmes.</p> <p>Valid For Auction: Ordren er kun aktiv og kan kun udføres i auktionsfaser (som kan være forudbestemt af det medlem af eller den deltager på markedspladsen, der afgav ordren, f.eks. åbnings- og lukkeauktioner og/eller intradagauktion).</p> <p>Valid For Continuous Trading only: Ordren er kun aktiv under løbende handel.</p> | <p>»SESR« — Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>»VFAR« — Valid For Auction</p> <p>»VFCR« — Valid For Continuous Trading only</p> |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordre-data stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|---------------------------------|--|---|
| | | Andet: Alle yderligere angivelser, der er unikke for specifikke forretningsmodeller, handelsplatforme eller -systemer. | {ALPHANUM-4} tegn, der ikke allerede anvendes i markedspladsens egen klassificering. Dette felt udfyldes med flere mærker adskilt af komma, hvis flere typer er relevante. |
| 12 | Gyldighedsperiode og -tidspunkt | <p>Tidsstempel, der viser det tidspunkt, på hvilket ordren bliver aktiv eller fjernes fra ordrebogen.</p> <p>Good for day: Indføringsdatoen, med tidsstempel umiddelbart før midnat.</p> <p>Good till time: Indføringsdatoen og tidspunktet specificeret i ordren.</p> <p>Good till date: Den specificerede udløbsdato, med tidsstempel umiddelbart før midnat.</p> <p>Good till specified date and time: Den specificerede dato og det specificerede tidspunkt for udløb.</p> <p>Good after time: Indføringsdatoen og det specificerede tidspunkt, hvor ordren bliver aktiv.</p> <p>Good after date: Den specificerede dato, med tidsstempel umiddelbart efter midnat.</p> <p>Good after specified date and time: Den specificerede dato og det specificerede tidspunkt, hvor ordren bliver aktiv.</p> <p>Good till Cancel: Den sidste dato og det sidste tidspunkt, hvor ordren automatisk fjernes gennem markedsaktiviteter.</p> <p>Andet: Tidsstempel for alle yderligere gyldighedstyper.</p> | {DATE_TIME_FORMAT} Antallet af cifre efter »sekunder« bestemmes i henhold til artikel 2 i delegeret forordning (EU) 2017/574. |

Afsnit E — Prioritet og sekvensnummer

| | | | |
|----|-----------------------|--|--|
| 13 | Prioritetstidsstempel | Dette felt opdateres, hver gang en ordres prioritet ændres. | {DATE_TIME_FORMAT} Antallet af cifre efter »sekunder« bestemmes i henhold til artikel 2 i delegeret forordning (EU) 2017/574. |
| 14 | Prioritetsstørrelse | <p>For markedspladser, der anvender størrelse-tidsprioritet, udfyldes dette felt med et positivt tal, der svarer til mængden.</p> <p>Dette felt opdateres, hver gang ordrens prioritet ændres.</p> | Op til 20 numeriske positive cifre |
| 15 | Sekvensnummer | <p>Alle begivenheder i afsnit G identificeres ved positive heltal i stigende rækkefølge.</p> <p>Sekvensnummeret skal være unikt for hver type af begivenhed, være konsekvent for alle begivenheder, have tidsstempel fra operatøren af markedspladsen og være persistent for den dato, på hvilken begivenheden indtræffer.</p> | {INTEGER-50} |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|------|--|---|
|-----|------|--|---|

Afsnit F — Identifikation af ordren

| | | | |
|----|---|--|---------------|
| 16 | Segment-MIC-kode | <p>Identifikation af den markedsplads, hvor ordren blev afgivet.</p> <p>Hvis markedspladsen bruger segment-MIC-koder, skal segment-MIC-koden anvendes.</p> <p>Hvis markedspladsen ikke bruger segment-MIC-koder, skal den overordnede markedsidentifikationskode («operating MIC») anvendes.</p> | {MIC} |
| 17 | Ordrebogskode | Den alfanumeriske kode, som markedspladsen har fastsat for hver ordrebog. | {ALPHANUM-20} |
| 18 | Identifikationskode for finansielt instrument | Det finansielle instruments unikke og utvetydige identifikation. | {ISIN} |
| 19 | Modtagelsesdato | Dato for modtagelse af den oprindelige ordre. | {DATEFORMAT} |
| 20 | Ordreidentifikationskode | En alfanumerisk kode, der tildeles af operatøren af markedspladsen til den enkelte ordre. | {ALPHANUM-50} |

Afsnit G — Begivenheder, der påvirker ordren

| | | | |
|----|---|--|--|
| 21 | <p>Ny ordre, ændring af ordre, annullering af ordre, afvisning af ordre, delvis eller fuldstændig udførelse</p> | <p>Ny ordre: Modtagelse af en ny ordre af operatøren af markedspladsen.</p> <p>Udløst: En ordre, der kan udføres eller ikke kan udføres, afhængigt af tilfældet, efter at en forudbestemt betingelse er indtruffet.</p> <p>Erstattet af medlemmet af eller deltageren på markedspladsen: Når et medlem af eller en deltager eller kunde på markedspladsen på eget initiativ beslutter at ændre en eller flere egenskaber ved den ordre, medlemmet, deltageren eller kunden tidligere har indført i ordrebogen.</p> <p>Erstattet gennem markedsaktiviteter (automatisk): Når en eller flere egenskaber ved en ordre ændres af markedspladsoperatørens IT-systemer. Dette omfatter også, når en peg-ordres eller en trailing stop-ordres aktuelle egenskaber ændres for at afspejle, hvor ordren er placeret i ordrebogen.</p> <p>Erstattet gennem markedsaktiviteter (menneskelig medvirken): Når en eller flere egenskaber ved en ordre ændres af markedspladsoperatørens personale. Dette omfatter også, når et medlem af eller en deltager på markedspladsen har IT-problemer og har akut behov for at få sine ordrer annulleret.</p> <p>Statusændring på markedspladsmedlemmets eller -deltagerens initiativ: Heri indgår aktivering og deaktivering.</p> | <p>»NEWO« — Ny ordre</p> <p>»TRIG« — Udløst</p> <p>»REME« — Erstattet af medlemmet af eller deltageren på markedspladsen</p> <p>»REMA« — Erstattet gennem markedsaktiviteter (automatisk)</p> <p>»REMH« — Erstattet gennem markedsaktiviteter (menneskelig medvirken)</p> <p>»CHME« — Statusændring på markedspladsmedlemmets eller -deltagerens initiativ</p> |
|----|---|--|--|

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|------|--|---|
| | | <p>Statusændring gennem markedsaktiviteter.</p> <p>Annuleret på markedspladsmedlemmets eller -deltagerens initiativ: Når et medlem, en deltager eller en kunde på eget initiativ beslutter at annullere den ordre, vedkommende tidligere har indført.</p> <p>Annuleret gennem markedsaktiviteter: Dette omfatter også en beskyttelsesmekanisme for investeringsselskaber, der udfører en prisstillelse i henhold til artikel 17 og 48 i direktiv 2014/65/EU.</p> <p>Afvist ordre: En modtaget ordre, der afvises af operatøren af markedspladsen.</p> <p>Udløbet ordre: Når ordren fjernes fra ordrebogen ved afslutningen af dens gyldighedsperiode.</p> <p>Delvist udført: Når ordren ikke er fuldstændig udført, så der er en resterende mængde, der skal udføres.</p> <p>Udført: Når der ikke er en resterende mængde, der skal udføres.</p> | <p>»CHMO« — Statusændring gennem markedsaktiviteter</p> <p>»CAME« — Annuleret på markedspladsmedlemmets eller -deltagerens initiativ</p> <p>»CAMO« — Annuleret gennem markedsaktiviteter</p> <p>»REMO«- Afvist ordre</p> <p>»EXPI«- Udløbet ordre</p> <p>»PARF« — Delvist udført</p> <p>»FILL« — Udført</p> <p>{ALPHANUM-4} tegn, der ikke allerede anvendes i markedspladsens egen klassificering.</p> |

Afsnit H — Type af ordre

| | | | |
|----|-----------------------------|---|---|
| 22 | Ordretype | Angiver, hvilken ordretype der er afgivet til markedspladsen efter markedspladsens specifikationer. | {ALPHANUM-50} |
| 23 | Klassifikation af ordretype | Klassifikation af ordren efter to generiske ordretyper. LIMIT-ordre (limiteret ordre): i de tilfælde, hvor ordren kan udføres, og STOP-ordre: i de tilfælde, hvor ordren først kan udføres, når en forudbestemt prisbegivenhed indtræffer. | Bogstaverne »LMTO« for limit eller bogstaverne »STOP« for stop. |

Afsnit I — Priser

| | | | |
|----|-----------|--|---|
| 24 | Limitpris | Den maksimumspris, som en købsordre kan handles til, eller den minimumspris, som en salgsordre kan handles til. Spreadprisen for en strategiorde. Den kan være negativ eller positiv. | {DECIMAL-18/13}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden. |
|----|-----------|--|---|

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|----------------------|--|--|
| | | <p>Dette felt udfyldes ikke i tilfælde af ordrer uden limitpris eller ordrer uden pris.</p> <p>I tilfælde af en konvertibel obligation oplyses den faktiske pris (»clean« eller »dirty«), der blev anvendt for ordren, i dette felt.</p> | <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> <p>{DECIMAL-18/17}, hvis prisen udtrykkes som basispoint</p> |
| 25 | Yderligere limitpris | <p>En anden limitpris, der kan gælde for ordren. Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant.</p> | <p>{DECIMAL-18/13}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi</p> <p>Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> <p>{DECIMAL-18/17}, hvis prisen udtrykkes som basispoint</p> |
| 26 | Stoppris | <p>Den pris, der skal nås, for at ordren bliver aktiv.</p> <p>For stopordrer, der udløses af begivenheder, der er uafhængige af prisen på det finansielle instrument, udfyldes dette felt med en stoppris lig med nul.</p> <p>Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant.</p> | <p>{DECIMAL-18/13}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi</p> <p>Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> <p>{DECIMAL-18/17}, hvis prisen udtrykkes som basispoint</p> |
| 27 | Pegged limitpris | <p>Den maksimumspris, som en pegged ordre om køb kan handles til, eller den minimumspris, som en pegged ordre om salg kan handles til.</p> <p>Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant.</p> | <p>{DECIMAL-18/13}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi</p> <p>Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> <p>{DECIMAL-18/17}, hvis prisen udtrykkes som basispoint</p> |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|--------------------------|--|---|
| 28 | Transaktionspris | <p>Transaktionens handelspris, eksklusiv provision og påløbne renter, hvor det er relevant.</p> <p>I tilfælde af optionskontrakter er det præmien for derivatkontrakten pr. underliggende aktiv eller indekspoint.</p> <p>I tilfælde af spread betting er det referenceprisen for det direkte underliggende instrument.</p> <p>I tilfælde af credit default swaps (CDS) er det kuponen i basispoint.</p> <p>Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden.</p> <p>Hvis pris ikke er relevant, udfyldes feltet med værdien »NOAP«.</p> | <p>{DECIMAL-18/13}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi</p> <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> <p>{DECIMAL-18/17}, hvis prisen udtrykkes som basispoint</p> <p>»NOAP«</p> |
| 29 | Prisvaluta | Den valuta, som handelsprisen for det finansielle instrument, der hører til ordren, udtrykkes i (relevant, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi). | {CURRENCYCODE_3} |
| 30 | Valuta for det andet ben | <p>I tilfælde af swaps i flere valutaer eller cross-currency swaps er det andet bens valuta den valuta, som kontraktens andet ben er denomineret i.</p> <p>Hvis der er tale om swaptioner, hvor den underliggende swap er i flere valutaer, er det andet bens valuta den valuta, som swappens andet ben er denomineret i.</p> <p>Dette felt udfyldes kun i tilfælde af rente- og valutaderivatkontrakter.</p> | {CURRENCYCODE_3} |
| 31 | Prisnotering | Angivelse af, om prisen udtrykkes som en pengeværdi, en procentsats, afkast eller basispoint. | <p>»MONE« — Pengeværdi</p> <p>»PERC« — Procentsats</p> <p>»YIEL« — Afkast</p> <p>»BAPO« — Basispoint</p> |

Afsnit J — Ordreinstrukser

| | | | |
|----|--------------------|--|--|
| 32 | Køb/salg-indikator | <p>Viser, om ordren drejer sig om køb eller salg.</p> <p>I tilfælde af optioner og swaptioner er køberen den modpart, der har retten til at udnytte optionen, og sælgeren er den modpart, der sælger optionen og modtager en præmie.</p> <p>I tilfælde af futures og terminskontrakter, der ikke vedrører valutaer, er køberen den modpart, der køber instrumentet, og sælgeren den modpart, der sælger instrumentet.</p> <p>I tilfælde af swaps vedrørende værdipapirer er køberen den modpart, der overtager risikoen ved prisudsvingene i det underliggende værdipapir og modtager sikkerhedsbeløbet. Sælgeren er den modpart, der betaler sikkerhedsbeløbet.</p> | <p>»BUYI« — køb</p> <p>»SELL« — salg</p> |
|----|--------------------|--|--|

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|-------------|--|---|
| | | <p>I tilfælde af swaps vedrørende renter eller inflationsindeks er køberen den modpart, der betaler den faste rente. Sælgeren er den modpart, der modtager den faste rente. I tilfælde af basiswaps (float-to-float-renteswaps) er køberen den modpart, der betaler spread, og sælgeren den modpart, der modtager spread.</p> <p>I tilfælde af swaps og terminkontrakter vedrørende valutaer og cross-currency swaps er køberen den modpart, der modtager den valuta, der står først efter alfabetisk rækkefølge efter ISO 4217-standard, og sælgeren er den modpart, der leverer denne valuta.</p> <p>I tilfælde af swaps vedrørende udbytte er køberen den modpart, der modtager de tilsvarende faktiske udbytteudbetalinger. Sælgeren er den modpart, der betaler udbyttet og modtager den faste rente.</p> <p>I tilfælde af derivatinstrumenter til overførsel af kreditrisiko, bortset fra optioner og swaptioner, er køberen den modpart, der betaler beskyttelsen. Sælgeren er den modpart, der sælger beskyttelsen.</p> <p>I tilfælde af derivatkontrakter vedrørende råvarer eller emissionskvoter er køberen den modpart, der modtager den i rapporten specificerede råvare eller emissionskvote, og sælgeren den modpart, der leverer råvaren eller emissionskvoten.</p> <p>I tilfælde af fremtidige renteaftaler er køberen den modpart, der betaler den faste rente, og sælgeren den modpart, der modtager den faste rente.</p> <p>Ved en stigning i den notionelle værdi er køberen den samme som erhververen af det finansielle instrument i den oprindelige transaktion, og sælgeren er den samme som afhænderen af det finansielle instrument i den oprindelige transaktion.</p> <p>Ved et fald i den notionelle værdi er køberen den samme som afhænderen af det finansielle instrument i den oprindelige transaktion, og sælgeren er den samme som erhververen af det finansielle instrument i den oprindelige transaktion.</p> | |
| 33 | Ordrestatus | <p>Identificerer ordrer, der er aktive/inaktive/suspenderede, faste/vejledende (tildeles kun prisstillelser)/implicitte/omdirigerede.</p> <p>Aktiv — ordrer uden prisstillelse, der kan udføres.</p> <p>Inaktiv — ordrer uden prisstillelse, der ikke kan udføres.</p> <p>Fast/vejledende — tildeles kun prisstillelser. Vejledende prisstillelser er prisstillelser, der er synlige, men som ikke kan udføres. Dette omfatter på nogle markedspladser også warrants. Faste prisstillelser kan udføres.</p> <p>Implicit — anvendes om strategi-ordrer, der hidrører fra funktionaliteten »implied in« eller »implied out«.</p> <p>Dirigeret — anvendes om ordrer, der dirigeres af markedspladsen til andre markedspladser.</p> | <p>»ACTI«- aktiv eller</p> <p>»INAC«- inaktiv eller</p> <p>»FIRM«- faste prisstillelser eller</p> <p>»INDI«- vejledende prisstillelser eller</p> <p>»IMPL«- implicitte strategi-ordrer eller</p> <p>»ROUT«- dirigerede ordrer.</p> <p>Hvis flere statusser er relevante, udfyldes dette felt med flere mærker adskilt af komma.</p> |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|--|--|---|
| 34 | Kvantitetsnotering | Angivelse af, om den indberettede mængde udtrykkes som antal af enheder, som en nominal værdi eller som en pengeværdi. | »UNIT« — antal enheder »NOML« — nominal værdi »MONE« — pengeværdi |
| 35 | Kvantitetsvaluta | Valuta, som mængden udtrykkes i. Feltet udfyldes kun, hvis mængden udtrykkes som en nominal værdi eller en pengeværdi. | {CURRENCYCODE_3} |
| 36 | Oprindelig mængde | Antallet af enheder af det finansielle instrument eller antallet af derivatkontrakter i ordren. Det finansielle instruments nominelle værdi eller pengeværdi. Ved spread betting er mængden den pengeværdi, der er indsat pr. pointbevægelse i det underliggende finansielle instrument. Ved en stigning eller et fald i notionelle derivatkontrakter afspejler tallet den absolutte værdi af ændringen og udtrykkes som et positivt tal. For credit default swaps er mængden det notionelle beløb, som beskyttelsen erhverves eller afhændes for. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |
| 37 | Resterende mængde, inklusive skjult mængde | Den samlede mængde, der forbliver i ordrebogen efter en delvis udførelse eller i tilfælde af enhver anden begivenhed, der påvirker ordren. I tilfælde af en delvist udført ordre er det den samlede resterende mængde efter den delvise udførelse. Ved en ordreindførelse svarer det til den oprindelige mængde. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |
| 38 | Vist mængde | Den mængde, der er synlig (i modsætning til skjult) i ordrebogen. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |
| 39 | Handlet mængde | Ved en delvis eller fuldstændig udførelse udfyldes dette felt med den udførte mængde. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |
| 40 | Mindste acceptable mængde (Minimum Acceptable Quantity — (MAQ) | Den mindste acceptable mængde for udførelsen af en ordre; den kan bestå af flere delvise udførelser og er sædvanligvis kun for ikke-persistente ordretyper. Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|---|---|---|
| 41 | Mindste udførelsesstørrelse (Minimum Executable Size — MES) | Den mindste udførelsesstørrelse for enhver individuel potentiel udførelse. Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant. | {DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder {DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi |
| 42 | MES — kun første udførelse | Angivelse af, om den mindste udførelsesstørrelse kun er relevant for den første udførelse. Det er ikke nødvendigt at udfylde dette felt, hvis felt 41 ikke er udfyldt. | »true« »false« |
| 43 | Indikator for kun passiv | Angiver, om ordren afgives til markedspladsen med et kendetegn/mærke, således at ordren ikke omgående skal udføres mod synlige kontraordrer. | »true« »false« |
| 44 | Passiv- eller aggressiv-indikator | Ved delvist og fuldstændig udførte ordrer angiver dette, om ordren allerede var i ordrebogen og tilvejebragte likviditet (passiv), eller om ordren indledte handelen og derved optog likviditet (aggressiv). Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant. | »PASV« — passiv »AGRE« — aggressiv |
| 45 | Forebyggelse af selvudførelse | Angiver, om ordren er blevet indført med kriterier for forebyggelse af selvudførelse, således at den ikke udføres med en ordre på den modsatte side af ordrebogen, der er indført af samme medlem eller deltager. | »true« »false« |
| 46 | Identifikation for strategi-forbundet ordre | Den alfanumeriske kode, der anvendes til at forbinde alle forbundne ordrer, der indgår som led i en strategi, jf. artikel 7,2. | {ALPHANUM-50} |
| 47 | Dirigeringsstrategi | Den relevante dirigeringsstrategi efter markedspladsens specifikationer. Dette felt udfyldes ikke, hvis det ikke er relevant. | {ALPHANUM-50} |
| 48 | Identifikationskode for markedspladstransaktion | Den alfanumeriske kode, der tildeles af markedspladsen til transaktionen i henhold til artikel 12 i denne forordning. Identifikationskoden for markedspladstransaktionen skal være unik, konsekvent og persistent pr. ISO10383-segment-MIC og pr. handelsdag. Hvis markedspladsen ikke anvender segment-MIC-koder, skal identifikationskoden for markedspladsstransaktionen være unik, konsekvent og persistent pr. markedsidentifikationskode (»operating MIC«) pr. handelsdag. Elementerne i transaktionsidentifikationskoden må ikke oplyse identiteten af modparterne i den transaktion, som koden registreres for. | {ALPHANUM-52} |

| Nr. | Felt | Indhold af de oplysninger om ordrer, der skal stilles til rådighed for de kompetente myndigheder | Standarder og formater for oplysninger om ordrer, der skal anvendes, når de relevante ordredata stilles til rådighed for en kompetent myndighed efter anmodning |
|-----|------|--|---|
|-----|------|--|---|

Afsnit K — Handelsfaser, vejledende auktionspris og volumen

| | | | |
|----|----------------------------|--|---|
| 49 | Handelsfaser | Navnet på hver af de forskellige handelsfaser, i løbet af hvilke en ordre findes i ordrebogen, herunder handelsstop, automatiske afbrydelser af handelen og suspensioner. | {ALPHANUM-50} |
| 50 | Vejledende auktionspris | Uncrossingprisen, som auktionen ville afsluttes i på det pågældende tidspunkt med hensyn til det finansielle instrument, der er afgivet en eller flere ordrer for. | <p>{DECIMAL-18/5}, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi</p> <p>Hvis prisen er indberettet som en pengeværdi, oplyses den i hovedvalutaenheden.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, hvis prisen udtrykkes som procentsats eller afkast</p> |
| 51 | Vejledende auktionsvolumen | Volumen (antal af enheder af det finansielle instrument), der kan udføres til den vejledende auktionspris i felt 50, hvis auktionen blev afsluttet på netop det tidspunkt. | <p>{DECIMAL-18/17}, hvis mængden udtrykkes som antal enheder</p> <p>{DECIMAL-18/5}, hvis mængden udtrykkes som en pengeværdi eller en nominal værdi</p> |