

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2017/580 DER KOMMISSION**vom 24. Juni 2016****zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012⁽¹⁾, insbesondere Artikel 25 Absatz 3 Unterabsatz 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Betreiber von Handelsplätzen sollten nach eigenem Ermessen entscheiden können, in welcher Form sie Aufzeichnungen über einschlägige Daten mit Bezug auf sämtliche Aufträge für Finanzinstrumente führen. Im Interesse einer effektiven und effizienten Gestaltung der Sammlung, des Vergleichs und der Auswertung der einschlägigen Auftragsdaten zu Zwecken der Marktüberwachung sollten diese Daten, wenn sie von einer zuständigen Behörde gemäß Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 angefordert werden, den zuständigen Behörden unter Verwendung einheitlicher Standards und Formate übermittelt werden.
- (2) Um für Klarheit und Rechtssicherheit zu sorgen und zu verhindern, dass dieselben Daten doppelt gespeichert werden, gilt die vorliegende Verordnung für alle auftragsbezogenen Datenelemente, einschließlich der Angaben, die gemäß Artikel 26 Absätze 1 und 3 in der Meldung enthalten sein müssen.
- (3) Damit die zuständigen Behörden potenzielle Fälle von Marktmissbrauch oder Versuche des Marktmissbrauchs wirkungsvoll aufdecken und untersuchen können, müssen sie in der Lage sein, die möglicherweise wesentlich am Auftragsvorgang beteiligten Personen und Einheiten umgehend zu identifizieren; dies betrifft Mitglieder oder Teilnehmer von Handelsplätzen, für Anlage- und Ausführungsentscheidungen zuständige Einheiten, nicht ausführende Makler sowie Kunden, deren Aufträge entgegengenommen werden. Daher sollten Betreiber von Handelsplätzen Angaben zur Identifizierung dieser Parteien aufbewahren.
- (4) Damit die zuständigen Behörden verdächtige, auf einen möglichen Marktmissbrauch hindeutende Verhaltensmuster eines Kunden, wie etwa die Beauftragung mehrerer Wertpapierfirmen, besser erkennen können, sollten die Betreiber von Handelsplätzen Angaben zur Identität der Kunden aufzeichnen, in deren Auftrag ihre Mitglieder oder Teilnehmer den jeweiligen Auftrag eingereicht haben. Betreiber sollten diese Kunden mit einer eindeutigen Kennung versehen, um ihre zuverlässige und effiziente Identifizierung zu ermöglichen und dadurch zu einer effektiveren Analyse eines potenziellen Marktmissbrauchs, an dem diese Kunden beteiligt sein könnten, beizutragen.
- (5) Betreiber von Handelsplätzen sollten nicht für alle Kunden in der Handelskette Kennungen vergeben müssen, sondern nur für den Kunden, in dessen Auftrag das Mitglied oder der Teilnehmer den Auftrag eingereicht hat.
- (6) Die effiziente Aufdeckung von Marktmanipulation setzt die Erkennung von Market-Making-Strategien oder ähnlichen Aktivitäten voraus. Dies ermöglicht den zuständigen Behörden die Unterscheidung zwischen dem Auftragsaufkommen, bei dem der Wertpapierfirma die Bedingungen vom Emittenten des gehandelten Instruments oder vom Handelsplatz, bei dem der Auftrag eingereicht wurde, vorgegeben wurden, und dem Auftragsaufkommen, bei dem sie nach eigenem Ermessen oder dem Ermessen ihres Kunden tätig wurde.
- (7) Datum und Uhrzeit jeder Erteilung, Änderung, Stornierung, Zurückweisung oder Ausführung eines Auftrags sollten genau aufgezeichnet werden. Auf diese Weise können sämtliche Änderungen des Auftrags während dessen gesamter Abwicklung nachvollzogen werden, was zur Aufdeckung und Beurteilung potenzieller Marktmanipulationen und des Missbrauchs von Insiderwissen beitragen kann.

⁽¹⁾ ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84.

- (8) Um ein genaues und vollständiges Bild des Orderbuchs eines Handelsplatzes zu gewinnen, benötigen die zuständigen Behörden Angaben über die Handelszeiten, in denen Finanzinstrumente gehandelt werden. Anhand dieser Angaben kann insbesondere festgestellt werden, wann Auktionszeiträume oder der fortlaufende Handel begannen und endeten und ob es Aufträge gab, die zu außerplanmäßigen Volatilitätsunterbrechungen führten. Diese Angaben sind überdies erforderlich, um Wechselwirkungen zwischen Aufträgen zu erkennen, insbesondere, wenn das Ende von Handelszeiträumen, wie etwa bei Auktionen, zufällig ist. Angaben über indikative Auktionspreise und -volumen tragen unter Umständen ebenfalls zur Erkennung möglicher Auktionsmanipulationen bei. Da ein einziger Auftrag den indikativen Auktionspreis, das indikative Auktionsvolumen oder beides verändern kann, müssen die zuständigen Behörden die Auswirkungen jedes Auftrags auf diese Werte erkennen können. Ohne diese Angaben lässt sich schwerlich feststellen, auf welchen Auftrag eine Änderung dieser Werte zurückzuführen ist. Darüber hinaus sollte jedes relevante Ereignis mit einer laufenden Nummer gekennzeichnet werden, um im Falle des gleichzeitigen Auftretens von zwei oder mehr Ereignissen deren Reihenfolge erkennen zu können.
- (9) Anhand von Angaben über die Position der Aufträge im Orderbuch kann das Orderbuch rekonstruiert und die Reihenfolge der Auftragsausführung analysiert werden, was einen wesentlichen Bestandteil der Marktüberwachung zur Missbrauchsverhütung bildet. Die einem Auftrag zugewiesene Position hängt davon ab, nach welchem Prinzip das Handelssystem Prioritäten zuweist. Aus diesem Grund sollten Betreiber von Handelsplätzen die Priorität der Aufträge nach dem Prinzip der Preis-Sichtbarkeit-Zeit-Priorität oder der Volumen-Zeit-Priorität festlegen und aufzeichnen.
- (10) Im Interesse einer wirksamen Marktüberwachung muss eine Zuordnung der Aufträge zu den entsprechenden Geschäften vorgenommen werden können. Aus diesem Grund sollten Betreiber von Handelsplätzen eindeutige Transaktionsidentifikationscodes vergeben, anhand derer Aufträge und Geschäfte einander zugeordnet werden können.
- (11) Für jeden eingehenden Auftrag sollten Betreiber von Handelsplätzen die Art des Auftrags und die dazugehörigen spezifischen Ausführungsanweisungen aufzeichnen und aufbewahren, da die Kombination dieser beiden Elemente darüber entscheidet, wie ihre Matching-Engines die Aufträge entsprechend ihren eigenen Klassifizierungen bearbeiten. Diese genauen Angaben sind für die zuständigen Behörden unverzichtbar, um im Rahmen ihrer Marktüberwachung zur Missbrauchsverhütung die im Orderbuch eines gegebenen Handelsplatzes verzeichneten Handelstätigkeiten zu überwachen und insbesondere die Bewegung jedes einzelnen darin aufgeführten Auftrags nachzuvollziehen. Aufgrund der großen Vielfalt bereits bestehender sowie von Handelsplatzbetreibern potenziell neu gestalteter Auftragsarten, die mit technischen Besonderheiten versehen sind, ist allerdings zu vermuten, dass die zuständigen Behörden derzeit nicht unbedingt in der Lage sind, die Bewegungen in der Orderbüchern aller Handelsplätze anhand dieser auf den internen Klassifikationssystemen der Betreiber beruhenden genauen Angaben in einheitlicher Weise nachzuvollziehen. Damit die zuständigen Behörden jeden Auftrag im Orderbuch exakt auffinden können, sollten die Betreiber von Handelsplätzen daher jeden eingegangenen Auftrag zusätzlich als Limit-Order kennzeichnen, wenn er ausführbar ist, oder als Stop-Order, wenn er erst bei Eintreten eines vorab festgelegten Preisereignisses ausführbar wird.
- (12) Aus Gründen der Konsistenz und im Interesse reibungslos funktionierender Finanzmärkte sollten die in der vorliegenden Verordnung und die in der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 niedergelegten Bestimmungen vom selben Tag an gelten.
- (13) Die vorliegende Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (14) Die ESMA hat zu diesen Entwürfen offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der gemäß Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Umfang, Standards und Format der einschlägigen Auftragsdaten

- (1) Betreiber von Handelsplätzen halten für sämtliche Aufträge, die über ihre Systeme mitgeteilt werden, die in den Artikeln 2 bis 13 genannten Einzelheiten gemäß den Vorgaben in der zweiten und dritten Spalte von Tabelle 2 des Anhangs zur Verfügung der zuständigen Behörden, sofern diese Daten den jeweils aufgeführten Auftrag betreffen.

⁽¹⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

(2) Wenn zuständige Behörden gemäß Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 die in Absatz 1 genannten Einzelheiten anfordern, übermitteln Betreiber von Handelsplätzen diese Daten unter Verwendung der Standards und Formate, die in der vierten Spalte von Tabelle 2 des Anhangs der vorliegenden Verordnung vorgegeben sind.

Artikel 2

Identifizierung der einschlägigen Parteien

- (1) Betreiber von Handelsplätzen bewahren zu allen Aufträgen Aufzeichnungen auf, aus denen Folgendes hervorgeht:
- das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes, der den Auftrag am Handelsplatz eingereicht hat, wie in Feld 1 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben;
 - der Mitarbeiter oder Computeralgorithmus bei dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, bei dem der Auftrag eingereicht wird, der für die Anlageentscheidung in Bezug auf diesen Auftrag verantwortlich ist, wie in Feld 4 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben;
 - der Mitarbeiter oder Computeralgorithmus bei dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, der für die Ausführung des Auftrags verantwortlich ist, wie in Feld 5 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben;
 - das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes, der den Auftrag im Auftrag und im Namen eines anderen Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes weitergeleitet hat, anzugeben als nicht ausführender Makler, wie in Feld 6 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben;
 - der Kunde, in dessen Auftrag das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes den Auftrag beim Handelsplatz eingereicht hat, wie in Feld 3 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.
- (2) Wenn ein Mitglied oder Teilnehmer oder Kunde des Handelsplatzes nach der Gesetzgebung eines Mitgliedstaats berechtigt ist, einen Auftrag nach Eingang beim Handelsplatz einem Kunden zuzuweisen, dies aber zum Zeitpunkt des Eingangs noch nicht getan hat, ist der Auftrag so zu kennzeichnen, wie in Feld 3 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.
- (3) Wenn mehrere Aufträge als Sammelauftrag beim Handelsplatz eingereicht werden, ist der Sammelauftrag so zu kennzeichnen, wie in Feld 3 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

Artikel 3

Handelsbezogene Funktion der Mitglieder oder Teilnehmer des Handelsplatzes und Liquiditätszufuhr

- (1) Die handelsbezogene Funktion, in der ein Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes einen Auftrag einreicht, ist so zu kennzeichnen, wie in Feld 7 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.
- (2) Folgende Aufträge sind so zu kennzeichnen, wie in Feld 8 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben:
- Aufträge, die im Rahmen einer Market-Making-Strategie im Sinne der Artikel 17 und 48 der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ von einem Mitglied oder Teilnehmer beim Handelsplatz eingereicht wurden;
 - Aufträge, die im Rahmen einer sonstigen Liquiditätsversorgungsmaßnahme von einem Mitglied oder Teilnehmer auf der Grundlage von Bedingungen beim Handelsplatz eingereicht wurden, die entweder vom Emittenten des Instruments, das Gegenstand des Auftrags ist, oder vom betreffenden Handelsplatz vorab festgelegt wurden.

⁽¹⁾ Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).

*Artikel 4***Aufzeichnung von Datum und Uhrzeit**

- (1) Betreiber von Handelsplätzen zeichnen für alle Ereignisse, die in Feld 21 von Tabelle 2 des Anhangs der vorliegenden Verordnung aufgeführt sind, das Datum und die Uhrzeit auf und beachten dabei den Grad an Genauigkeit gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574 der Kommission ⁽¹⁾, wie in Feld 9 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben. Mit Ausnahme der Aufzeichnung von Datum und Uhrzeit der Zurückweisung von Aufträgen durch die Systeme der Handelsplätze sind alle Ereignisse, die in Feld 21 von Tabelle 2 des Anhangs der vorliegenden Verordnung aufgeführt werden, anhand der von den Matching-Engines der Handelsplätze im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren aufzuzeichnen.
- (2) Betreiber von Handelsplätzen zeichnen für alle Datenelemente, die in den Feldern 49, 50 und 51 von Tabelle 2 des Anhangs aufgeführt sind, Datum und Uhrzeit auf und beachten dabei den Grad an Genauigkeit gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574.

*Artikel 5***Gültigkeitsdauer und Auftragsbeschränkungen**

- (1) Betreiber von Handelsplätzen führen Aufzeichnungen über die Gültigkeitsdauern und Auftragsbeschränkungen, die in den Feldern 10 und 11 von Tabelle 2 des Anhangs aufgeführt sind.
- (2) Das Datum und die Uhrzeit jeder Gültigkeitsdauer ist so anzugeben, wie in Feld 12 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

*Artikel 6***Priorität und laufende Nummer**

- (1) Betreiber von Handelsplätzen, deren Handelssysteme auf dem Prinzip der Preis-Sichtbarkeit-Zeit-Priorität beruhen, zeichnen für alle Aufträge den zur Priorisierung vergebenen Zeitstempel auf, wie in Feld 13 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben. Für diesen Zeitstempel gilt gleichermaßen der in Artikel 4 Absatz 1 festgelegte Grad an Genauigkeit.
- (2) Zusätzlich zu dem in Absatz 1 genannten zur Priorisierung verwendeten Zeitstempel zeichnen Betreiber von Handelsplätzen, deren Handelssysteme auf dem Prinzip der Volumen-Zeit-Priorität beruhen, die zur Priorisierung der Aufträge verwendeten Volumina auf, wie in Feld 14 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.
- (3) Für Betreiber von Handelsplätzen, deren Handelssysteme auf einer Kombination von Preis-Sichtbarkeit-Zeit-Priorität und Volumen-Zeit-Priorität beruhen und die Aufträge im Orderbuch nach Zeit-Priorität anzeigen, kommt Absatz 1 zur Anwendung.
- (4) Für Betreiber von Handelsplätzen, deren Handelssysteme auf einer Kombination von Preis-Sichtbarkeit-Zeit-Priorität und Volumen-Zeit-Priorität beruhen und die Aufträge im Orderbuch nach Volumen-Priorität anzeigen, kommt Absatz 2 zur Anwendung.
- (5) Betreiber von Handelsplätzen weisen allen Ereignissen eine laufende Nummer zu und zeichnen diese so auf, wie in Feld 15 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

*Artikel 7***Identifikationscodes für Aufträge für Finanzinstrumente**

- (1) Betreiber von Handelsplätzen vergeben für jeden Auftrag einen individuellen Identifikationscode, wie in Feld 20 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben. Dieser Identifikationscode muss pro Orderbuch, pro Handelstag und pro Finanzinstrument eindeutig sein. Er gilt vom Zeitpunkt des Auftragseingangs beim Betreiber des Handelsplatzes bis zur Entfernung des Auftrags aus dem Orderbuch. Der Identifikationscode ist unabhängig vom Grund für die Zurückweisung auch für zurückgewiesene Aufträge zu vergeben.

⁽¹⁾ Delegierte Verordnung (EU) 2017/574 der Kommission vom 7. Juni 2016 zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (siehe Seite 148 dieses Amtsblatts).

(2) Der Betreiber des Handelsplatzes bewahrt die einschlägigen Daten über öffentlich bekanntgegebene Strategieorder mit „Implied“-Funktionalität (SOIF) auf, wie im Anhang vorgegeben. In Feld 33 von Tabelle 2 des Anhangs ist anzugeben, ob es sich um einen impliziten Auftrag handelt.

Nach Ausführung eines SOIF hat der Betreiber des Handelsplatzes Aufzeichnungen über die Einzelheiten aufzubewahren, wie im Anhang vorgegeben.

Nach Ausführung eines SOIF ist ein Identifikationscode für die Strategieorder anzugeben, so dass alle mit der betreffenden Strategie verbundenen Aufträge durch denselben Identifikationscode gekennzeichnet werden. Der Identifikationscode für die Strategieorder ist so anzugeben, wie in Feld 46 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

(3) Bei einem Handelsplatz eingereichte Aufträge, für die eine Weiterleitungsstrategie zulässig ist, werden von dem betreffenden Handelsplatz im Falle einer Weiterleitung an einen anderen Handelsplatz als „weitergeleitet“ gekennzeichnet, wie in Feld 33 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben. Bei einem Handelsplatz eingereichte Aufträge, für die eine Weiterleitungsstrategie zulässig ist, behalten unabhängig davon, ob eine Restmenge erneut im Ordereingangsbuch verzeichnet wird, stets den gleichen Identifikationscode bei.

Artikel 8

Ereignisse mit Auswirkungen auf Aufträge für Finanzinstrumente

Betreiber von Handelsplätzen führen in Bezug auf neue Aufträge Aufzeichnungen über die in Feld 21 von Tabelle 2 des Anhangs aufgeführten Einzelheiten.

Artikel 9

Art des Auftrags für Finanzinstrumente

(1) Betreiber von Handelsplätzen führen unter Verwendung ihres eigenen Klassifikationssystems Aufzeichnungen über die Art jedes eingegangenen Auftrags, wie in Feld 22 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

(2) Betreiber von Handelsplätzen stufen jeden eingegangenen Auftrag als Limit-Order oder als Stop-Order ein, wie in Feld 23 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

Artikel 10

Preise mit Bezug auf Aufträge

Betreiber von Handelsplätzen führen Aufzeichnungen über alle in Abschnitt 1 von Tabelle 2 des Anhangs genannten Preisangaben, sofern sie für die Aufträge relevant sind.

Artikel 11

Auftragsanweisungen

Betreiber von Handelsplätzen führen Aufzeichnungen über sämtliche für jeden Auftrag eingegangenen Anweisungen, wie in Abschnitt J von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

Artikel 12

Vom Handelsplatz verbgebener Transaktionsidentifikationscode

Betreiber von Handelsplätzen kennzeichnen jedes Geschäft, das auf die vollständige oder teilweise Ausführung eines Auftrags zurückgeht, mit einem individuellen Transaktionsidentifikationscode, wie in Feld 48 von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.

*Artikel 13***Handelsphasen und indikativer Auktionspreis sowie indikatives Auktionsvolumen**

- (1) Betreiber von Handelsplätzen führen Aufzeichnungen über die Auftragsdaten, wie in Abschnitt K von Tabelle 2 des Anhangs vorgegeben.
- (2) Wenn die zuständigen Behörden gemäß Artikel 1 die in Abschnitt K aufgeführten Angaben anfordern, gelten auch die in Feld 9 und die in den Feldern 15 bis 18 von Tabelle 2 des Anhangs aufgeführten Angaben als relevant für den Auftrag, auf den sich die Anforderung bezieht.

*Artikel 14***Inkrafttreten und Anwendung**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem in Artikel 55 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 genannten Datum.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 24. Juni 2016

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

ANHANG

Tabelle 1

Legende zu Tabelle 2

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld
{CURRENCYCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Datums- und Zeitformat nach ISO 8601	Datum und Uhrzeit in folgendem Format: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddZ — „YYYY“ bezeichnet das Jahr. — „MM“ bezeichnet den Monat. — „DD“ bezeichnet den Tag. — „T“ bedeutet, dass der Buchstabe „T“ verwendet werden soll. — „hh“ bezeichnet die Stunde. — „mm“ bezeichnet die Minute. — „ss.ddd“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde. — Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit). Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben.
{DATEFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Das Datum ist in folgendem Format anzugeben: YYYY-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen insgesamt, wovon bis zu m Stellen Nachkommastellen sein können	Numerisches Feld für positive und negative Werte: — Dezimaltrennzeichen ist der Punkt (.); — negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt; — Werte werden gerundet und nicht abgeschnitten.
{INTEGER-n}	Ganze Zahl mit bis zu n Ziffern insgesamt	Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Kennung für juristische Personen gemäß ISO 17442
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	Codes für die Identifizierung von Handelsplätzen gemäß ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alphanumerische Zeichen	Kennung, die in Artikel 6 und Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission ⁽¹⁾ festgelegt ist.

⁽¹⁾ Delegierte Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission vom 28. Juli 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Meldung von Geschäften an die zuständigen Behörden (siehe Seite 449 dieses Amtsblatts).

Tabelle 2

Auftragsdaten

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
-----	------	--	---

Abschnitt A — Identifizierung der einschlägigen Parteien

1	Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat	Die Identität des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes. Bei direktem elektronischem Zugang (DEA) ist die Identität des DEA-Bereitstellers anzugeben.	{LEI}
2	Direkter elektronischer Zugang (DEA)	„zutreffend“, wenn der Auftrag über einen direkten elektronischen Zugang (im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 41 der Richtlinie 2014/65/EU an den Handelsplatz übermittelt wurde. „nicht zutreffend“, wenn der Auftrag nicht über einen direkten elektronischen Zugang (im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 41 der Richtlinie 2014/65/EU an den Handelsplatz übermittelt wurde.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
3	Kundenidentifikationscode	Code zur Identifikation des Kunden des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes. Im Falle eines direkten elektronischen Zugangs ist der Code des DEA-Nutzers anzugeben. Wenn der Kunde eine juristische Person ist, ist der LEI-Code des Kunden zu verwenden. Ist der Kunde keine juristische Person, ist die {NATIONAL_ID} zu verwenden. Bei Sammelaufträgen ist das Kennzeichen „AGGR“ zu verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 3 der vorliegenden Verordnung). Wenn die Zuweisung des Auftrags noch aussteht, ist das Kennzeichen „PNAL“ zu verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 2 der vorliegenden Verordnung). Dieses Feld ist nur dann leer zu lassen, wenn das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes keinen Kunden hat.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR“ — Sammelaufträge „PNAL“ — Zuweisung ausstehend
4	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, die oder der für die Anlageentscheidung verantwortlich ist (siehe Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590). Ist eine natürliche Person bei dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes für die Anlageentscheidung verantwortlich, ist die für die Anlageentscheidung verantwortliche oder vorrangig verantwortliche Person mit ihrer {NATIONAL_ID} anzugeben. Wurde die Anlageentscheidung durch einen Algorithmus getroffen, ist das Feld gemäß Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 auszufüllen. Dieses Feld ist leer zu lassen, wenn die Anlageentscheidung nicht von einer Person oder einem Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes getroffen wurde.	{NATIONAL_ID} — natürliche Person {ALPHANUM-50} — Algorithmus
5	Ausführung innerhalb der Firma	Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, die oder der für die Ausführung des aus dem Auftrag resultierenden Geschäfts verantwortlich ist (siehe Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590). Ist für die Ausführung des Geschäfts eine natürliche Person verantwortlich, ist die Person mit ihrer {NATIONAL_ID} anzugeben.	{NATIONAL_ID} — natürliche Person {ALPHANUM-50} — Algorithmus

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		Ist für die Ausführung des Geschäfts ein Algorithmus verantwortlich, ist das Feld gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 auszufüllen. Wenn mehr als eine Person oder sowohl Personen als auch Algorithmen an der Ausführung des Geschäfts beteiligt sind, bestimmt das Mitglied, der Teilnehmer oder der Kunde des Handelsplatzes den vorrangig verantwortlichen Händler oder Algorithmus (siehe Artikel 9 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590) und trägt in dieses Feld die Kennung dieses Händlers oder Algorithmus ein.	
6	Nicht ausführender Makler	Gemäß Artikel 2 Buchstabe d. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{LEI}

Abschnitt B — Handelsbezogene Funktion und Liquiditätszufuhr

7	Handelsbezogene Funktion	Gibt an, ob der Auftragseingang daraus resultiert, dass das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes im Sinne von Artikel 4 Nummer 38 der Richtlinie 2014/65/EU sich deckende Kundenaufträge zusammenführt oder im Sinne von Artikel 4 Nummer 6 der Richtlinie 2014/65/EU Handel für eigene Rechnung betreibt. Resultiert der Auftragseingang nicht aus einer Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge oder dem Handel für eigene Rechnung, ist in diesem Feld anzugeben, dass das Geschäft im Rahmen anderer Funktionen ausgeführt wurde.	„DEAL“ — Handel für eigene Rechnung „MTCH“ — Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge „AOTC“ — andere Funktion
8	Liquiditätszufuhr	Gibt an, ob ein Auftrag im Rahmen einer Market-Making-Strategie gemäß der Artikel 17 und 48 der Richtlinie 2014/65/EU oder im Rahmen einer sonstigen Tätigkeit gemäß Artikel 3 dieser Verordnung an einen Handelsplatz weitergeleitet wird.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“

Abschnitt C — Datum und Uhrzeit

9	Datum und Uhrzeit	Datum und Uhrzeit für jedes in den Abschnitten [G] und [K] aufgeführte Ereignis.	{DATE_TIME_FORMAT} Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574 zu bestimmen.
---	-------------------	--	---

Abschnitt D — Gültigkeitsdauer und Auftragsbeschränkungen

10	Gültigkeitsdauer	Good-For-Day: Der Auftrag erlischt am Ende des Handelstags, an dem er in das Orderbuch eingegeben wurde. Good-Till-Cancelled: Der Auftrag ist so lange im Orderbuch aktiv und ist ausführbar, bis er storniert wird.	„DAVY“ — Good-For-Day „GTCV“ — Good-Till-Cancelled
----	------------------	---	---

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		<p>Good-Till-Time: Der Auftrag erlischt spätestens zu einer festgesetzten Uhrzeit am aktuellen Geschäftstag.</p> <p>Good-Till-Date: Der Auftrag erlischt nach Ablauf eines bestimmten Datums.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time: Der Auftrag erlischt an einem bestimmten Datum zu einer bestimmten Uhrzeit.</p> <p>Good After Time: Der Auftrag ist erst nach Ablauf einer festgesetzten Uhrzeit am aktuellen Geschäftstag aktiv.</p> <p>Good After Date: Der Auftrag ist erst ab einem festgesetzten Datum aktiv.</p> <p>Good After Specified Date and Time: Der Auftrag ist erst ab einer festgesetzten Uhrzeit am festgesetzten Datum aktiv.</p> <p>Immediate-Or-Cancel: ein Auftrag, der bei seiner Eingabe ins Orderbuch sofort (für die ausführbare Menge) ausgeführt wird und der für die restliche Menge (sofern vorhanden), die nicht ausgeführt werden konnte, nicht im Orderbuch verbleibt.</p> <p>Fill-Or-Kill: ein Auftrag, der bei seiner Eingabe ins Orderbuch sofort ausgeführt wird, sofern er vollständig ausgeführt werden kann. Falls der Auftrag nur teilweise ausgeführt werden kann, wird er automatisch zurückgewiesen und kann somit nicht ausgeführt werden.</p> <p>Sonstige: alle weiteren Angaben, die speziell für bestimmte Geschäftsmodelle, Handelsplattformen oder Handelssysteme gelten.</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 oder {ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p>
11	Auftragsbeschränkung	<p>Good For Closing Price Crossing Session: wenn sich ein Auftrag für den Schlusskurs einer Crossing Session qualifiziert.</p> <p>Valid For Auction: Der Auftrag ist nur während Auktionsphasen aktiv und kann nur in diesen Phasen ausgeführt werden (diese können von dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, das/der den Auftrag eingereicht hat, festgelegt werden, wie Eröffnungs- und/Schlussauktionen und/oder Auktionen innerhalb eines Tages).</p> <p>Valid For Continuous Trading only: Der Auftrag ist nur während des fortlaufenden Handels aktiv.</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.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		Sonstige: alle weiteren Angaben, die speziell für bestimmte Geschäftsmodelle, Handelsplattformen oder Handelssysteme gelten.	{ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden Treffen mehrere Möglichkeiten zu, sind diese hier durch Komata getrennt anzugeben.
12	Datum und Uhrzeit der Gültigkeitsdauer	Diese Angabe bezieht sich auf den Zeitstempel, der den Zeitpunkt wiedergibt, zu dem der Auftrag aktiv wird oder definitiv aus dem Orderbuch gelöscht wird. Good-For-Day: Eingangsdatum mit einem Zeitstempel unmittelbar vor Mitternacht. Good-Till-Time: Eingangsdatum und im Auftrag angegebene Uhrzeit. Good-Till-Date: angegebenes Ablaufdatum mit einem Zeitstempel unmittelbar vor Mitternacht. Good-Till-Specified Date and Time: für den Ablauf der Gültigkeit angegebenes Datum und angegebene Uhrzeit. Good After Time: Eingangsdatum und angegebene Uhrzeit, zu der der Auftrag aktiv wird. Good After Date: angegebenes Datum mit einem Zeitstempel unmittelbar nach Mitternacht. Good After Specified Date and Time: angegebenes Datum und angegebene Uhrzeit, zu der der Auftrag aktiv wird. Good-Till-Cancelled: letztes Datum und letzte Uhrzeit, zu dem der Auftrag infolge des Handelsbetriebs automatisch gelöscht wird. Sonstige: Zeitstempel für jeden weiteren Gültigkeitstyp,	{DATE_TIME_FORMAT} Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574 zu bestimmen.

Abschnitt E — Priorität und laufende Nummer

13	Zeitstempel zur Priorisierung von Aufträgen	Dieses Feld ist jeweils zu aktualisieren, wenn sich die Priorität eines Auftrags ändert.	{DATE_TIME_FORMAT} Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ wird gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574 bestimmt.
14	Prioritätsvolumen	Bei Handelsplätzen, die Volumen-Zeit-Priorität verwenden, ist in dieses Feld eine positive Zahl einzutragen, die der Menge entspricht. Dieses Feld ist jeweils zu aktualisieren, wenn sich die Priorität des Auftrags ändert.	Bis zu 20 positive numerische Zeichen
15	Laufende Nummer	Jedes in Abschnitt G aufgeführte Ereignis ist durch positive Ganzzahlen in aufsteigender Reihenfolge zu identifizieren. Für jeden Ereignistyp darf nur eine laufende Nummer vergeben werden, diese muss über alle vom Handelsplatzbetreiber mit einem Zeitstempel versehenen Ereignisse konsistent sein, und sie muss für das Datum, an dem das Ereignis eintritt, fortbestehen.	{INTEGER-50}

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
-----	------	--	---

Abschnitt F — Identifikation des Auftrags

16	Segment MIC	<p>Kennung des Handelsplatzes, an dem der Auftrag eingereicht wurde.</p> <p>Verwendet der Handelsplatz Segment MICs, dann ist der Segment MIC zu verwenden.</p> <p>Verwendet der Handelsplatz keine Segment MICs, dann ist der Operating MIC zu verwenden.</p>	{MIC}
17	Orderbuch-Code	Der vom Handelsplatz für jedes Orderbuch festgelegte alphanumerische Code	{ALPHANUM-20}
18	Identifikationscode des Finanzinstruments	Eindeutige Kennung des Finanzinstruments	{ISIN}
19	Eingangsdatum	Eingangsdatum des ursprünglichen Auftrags	{DATEFORMAT}
20	Auftragsidentifikationscode	Ein alphanumerischer Code, der einem einzelnen Auftrag vom Handelsplatzbetreiber zugewiesen wird	{ALPHANUM-50}

Abschnitt G — Ereignisse mit Auswirkungen auf den Auftrag

21	Neuer Auftrag, Ändern des Auftrags, Stornieren des Auftrags, Zurückweisen des Auftrags, vollständige oder teilweise Ausführung	<p>Neuer Auftrag: Eingang eines neuen Auftrags beim Betreiber des Handelsplatzes.</p> <p>Ausgelöst: ein Auftrag, der bei Eintreten einer zuvor festgelegten Bedingung ausführbar oder ggf. nicht ausführbar wird.</p> <p>Vom Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes ersetzt: wenn ein Mitglied, ein Teilnehmer oder ein Kunde des Handelsplatzes auf eigene Initiative beschließt, Merkmale des zuvor von ihm in das Orderbuch eingegebenen Auftrags zu ändern.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs ersetzt (automatisch): wenn Merkmale eines Auftrags durch die IT-Systeme des Handelsplatzbetreibers geändert werden. Dies umfasst auch die Änderung der aktuellen Merkmale einer Pegged-Order oder Trailing-Stop-Order, um die Position des Auftrags im Orderbuch wiederzugeben.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs ersetzt (menschliches Eingreifen): wenn ein Merkmal eines Auftrags durch Mitarbeiter des Handelsplatzbetreibers geändert wird. Dies umfasst auch den Fall, dass bei einem Mitglied, Teilnehmer des Handelsplatzes IT-Probleme aufgetreten sind und dessen Aufträge dringend storniert werden müssen.</p> <p>Änderung des Status auf Initiative des Mitglieds, Teilnehmers des Handelsplatzes: umfasst die Aktivierung und Deaktivierung von Aufträgen.</p>	<p>„NEWO“ — neuer Auftrag</p> <p>„TRIG“ — ausgelöst</p> <p>„REME“ — vom Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes ersetzt</p> <p>„REMA“ — infolge des Handelsbetriebs ersetzt (automatisch)</p> <p>„REMH“ — infolge des Handelsbetriebs ersetzt (menschliches Eingreifen)</p> <p>„CHME“ — Änderung des Status auf Initiative des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes</p>
----	--	--	--

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		<p>Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs</p> <p>Auf Initiative des Mitglieds, Teilnehmers des Handelsplatzes storniert: wenn ein Mitglied, ein Teilnehmer oder ein Kunde auf eigene Initiative beschließt, den von ihm zuvor eingegebenen Auftrag zu stornieren.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs storniert: Dies umfasst einen Schutzmechanismus, der für Wertpapierfirmen verfügbar ist, die Market-Making-Tätigkeiten gemäß Artikel 17 und Artikel 48 der Richtlinie 2014/65/EU ausführen.</p> <p>Zurückgewiesener Auftrag: ein eingegangener, jedoch vom Betreiber des Handelsplatzes zurückgewiesener Auftrag.</p> <p>Abgelaufener Auftrag: wenn der Auftrag nach Ablauf seiner Gültigkeitsdauer aus dem Orderbuch gelöscht wird.</p> <p>Teilweise ausgeführt: wenn der Auftrag nicht vollständig ausgeführt wird, so dass eine auszuführende Restmenge verbleibt.</p> <p>Vollständig ausgeführt: wenn keine Menge mehr zur Ausführung verbleibt.</p>	<p>„CHMO“ — Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs</p> <p>„CAME“ — auf Initiative des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes storniert</p> <p>„CAMO“ — infolge des Handelsbetriebs storniert</p> <p>„REMO“ — zurückgewiesener Auftrag</p> <p>„EXPI“ — abgelaufener Auftrag</p> <p>„PARF“ — teilweise ausgeführt</p> <p>„FILL“ — vollständig ausgeführt {ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p>

Abschnitt H — Art des Auftrags

22	Auftragsart	Gibt die Art des Auftrags an, der dem Handelsplatz gemäß dessen Spezifikationen übermittelt wird.	{ALPHANUM-50}
23	Klassifizierung der Auftragsart	<p>Klassifizierung des Auftrags nach zwei allgemeinen Auftragsarten. Limit-Order: wenn der Auftrag ausführbar ist und</p> <p>Stop-Order: wenn der Auftrag nur bei Eintreten eines vorab festgelegten Preisereignisses ausführbar wird</p>	„LMTO“ für Limit-Order oder „STOP“ für Stop-Order

Abschnitt I — Preise

24	Limitpreis	<p>Höchstpreis, zu dem ein Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu dem ein Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann.</p> <p>Spreadpreis bei einer Strategieorder. Dieser Wert kann negativ oder positiv sein.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p>
----	------------	---	---

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		<p>Für Aufträge ohne Limitpreis oder Aufträge, für die kein Preis festgesetzt ist, ist dieses Feld leer zu lassen.</p> <p>Bei einer Wandelanleihe ist in diesem Feld der tatsächliche Preis (Clean Price oder Dirty Price) für den Auftrag anzugeben.</p>	<p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
25	Weiterer Limitpreis	Jeder andere Limitpreis, der für den Auftrag gelten kann. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
26	Stop-Preis	<p>Der Preis, der erreicht werden muss, damit der Auftrag aktiv wird.</p> <p>Für Stop-Order, die durch Ereignisse ausgelöst werden, die nicht vom Preis des Finanzinstruments abhängig sind, ist in diesem Feld ein Stop-Preis gleich null einzugeben.</p> <p>Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
27	Pegged-Limitpreis	<p>Höchstpreis, zu dem eine Pegged-Order als Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu dem eine Pegged-Order als Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann.</p> <p>Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
28	Transaktionspreis	<p>Handelspreis der Transaktion, ggf. ohne Provision und aufgelaufene Zinsen.</p> <p>Bei Optionskontrakten ist dies die Prämie des Derivatekontrakts pro Basiswert oder Indexpunkt.</p> <p>Bei Spread Bets ist dies der Referenzpreis des direkten zugrunde liegenden Finanzinstruments.</p> <p>Bei Credit Default Swaps (CDS) ist dies der Kupon in Basispunkten.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>Wenn kein Preis anwendbar ist, ist in diesem Feld „NOAP“ anzugeben.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p> <p>„NOAP“</p>
29	Währung des Preises	Währung, in der der Handelspreis des Finanzinstruments, auf das sich der Auftrag bezieht, ausgedrückt wird (in Fällen, in denen der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird).	{CURRENCYCODE_3}
30	Währung von Leg 2	<p>Bei Multi-Currency- oder Cross-Currency-Swaps ist die Währung von Leg 2 die Währung, auf die Leg 2 des Kontrakts lautet.</p> <p>Bei Swaptions, bei denen der zugrunde liegende Swap mehrere Währungen umfasst, ist die Währung von Leg 2 die Währung, auf die Leg 2 des Swaps lautet.</p> <p>Dieses Feld muss nur bei Zins- und Währungsderivatkontrakten ausgefüllt werden.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Preisnotierung	Gibt an, ob der Preis als monetärer Wert, in Prozent, als Rendite oder in Basispunkten ausgedrückt wird.	<p>„MONE“ — monetärer Wert</p> <p>„PERC“ — Prozent</p> <p>„YIEL“ — Rendite</p> <p>„BAPO“ — Basispunkte</p>

Abschnitt J — Auftragsanweisungen

32	Kauf/Verkauf-Indikator	<p>Angabe, ob es sich bei dem Auftrag um einen Kauf oder einen Verkauf handelt.</p> <p>Bei Optionen und Swaptions ist der Käufer die Gegenpartei, die das Recht zur Ausübung der Option innehat, und der Verkäufer die Gegenpartei, die die Option verkauft und eine Prämie erhält.</p> <p>Bei Futures und Forwards, die sich nicht auf Währungen beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die das Instrument kauft, und der Verkäufer die Gegenpartei, die das Instrument verkauft.</p> <p>Bei Swaps, die sich auf Wertpapiere beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die das Risiko der Preisbewegung des zugrunde liegenden Wertpapiers übernimmt und den Wertpapierbetrag erhält. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die den Wertpapierbetrag zahlt.</p>	<p>„BUYI“ — Kauf</p> <p>„SELL“ — Verkauf</p>
----	------------------------	--	--

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
		<p>Bei Swaps, die sich auf Zinssätze oder Inflationsindizes beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die den Festzins zahlt. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die den Festzins erhält. Bei Basisswaps (Float-to-Float-Zinsswaps) ist der Käufer die Gegenpartei, die den Spread zahlt, und der Verkäufer die Gegenpartei, die den Spread erhält.</p> <p>Bei Swaps und Forwards, die sich auf Währungen beziehen, und bei Cross Currency Swaps ist der Käufer die Gegenpartei, welche die Währung erhält, die bei einer alphabetischen Sortierung nach den ISO 4217-Codes an erster Stelle steht, und der Verkäufer die Gegenpartei, die diese Währung liefert.</p> <p>Bei Swaps, die sich auf Dividenden beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die die äquivalenten tatsächlichen Dividendenzahlungen erhält. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die die Dividende zahlt und den Festzins erhält.</p> <p>Bei derivativen Finanzinstrumenten zur Übertragung des Kreditrisikos, mit Ausnahme von Optionen und Swaptions, ist der Käufer die Gegenpartei, die diese Absicherung kauft. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die diese Absicherung verkauft.</p> <p>Bei Warenderivat- oder Emissionszertifikatderivat-Kontrakten ist der Käufer die Gegenpartei, die die angegebene Ware oder das angegebene Emissionszertifikat erhält, und der Verkäufer die Gegenpartei, die diese Ware/dieses Emissionszertifikat liefert.</p> <p>Bei Zinstermingeschäften (Forward Rate Agreements) ist der Käufer die Gegenpartei, die den Festzins zahlt, und der Verkäufer die Gegenpartei, die den Festzins erhält.</p> <p>Bei einer Erhöhung des Nominalwerts entspricht der Käufer dem Erwerber des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts, und der Verkäufer entspricht dem Veräußerer des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts.</p> <p>Bei einer Verringerung des Nominalwerts entspricht der Käufer dem Veräußerer des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts, und der Verkäufer dem Erwerber des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts.</p>	
33	Auftragsstatus	<p>Zur Identifizierung von Aufträgen, die aktiv/inaktiv/ausgesetzt, verbindlich/indikativ (nur Offerten zugewiesen)/implizit/weitergeleitet sind.</p> <p>Aktiv — nicht Offerten zugewiesene Aufträge, die ausführbar sind.</p> <p>Inaktiv — nicht Offerten zugewiesene Aufträge, die nicht ausführbar sind.</p> <p>Verbindlich/Indikativ — nur Offerten zugewiesen. Indikative Offerten bedeuten, dass sie sichtbar sind, aber nicht ausgeführt werden können. An einigen Handelsplätzen sind hierin Bezugsrechte eingeschlossen. Verbindliche Offerten können ausgeführt werden.</p> <p>Implizit — für Strategieorders, die von der Implied in- oder Implied out-Funktionalität abgeleitet werden.</p> <p>Weitergeleitet — für Aufträge, die vom Handelsplatz an andere Handelsplätze weitergeleitet werden.</p>	<p>„ACTI“ — aktiv oder „INAC“ — inaktiv oder „FIRM“ — verbindliche Offerten oder „INDI“ — indikative Offerten oder „IMPL“ — implizierte Strategieorders oder „ROUT“ — weitergeleitete Aufträge Treffen mehrere Möglichkeiten zu, sind diese hier durch Kommata getrennt anzugeben.</p>

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
34	Mengennotierung	Gibt an, ob die angegebene Menge als Anzahl der Einheiten, als Nominalwert oder als monetärer Wert ausgedrückt wird.	„UNIT“ — Anzahl der Einheiten „NOML“ — Nominalwert „MONE“ — monetärer Wert
35	Währung der Menge	Währung, in der die Menge ausgedrückt wird. Nur anzugeben, wenn die Menge als Nominalwert oder monetärer Wert ausgedrückt wird.	{CURRENCYCODE_3}
36	Anfangsmenge	Die Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments oder die Anzahl der Derivatekontrakte im Auftrag. Der Nominalwert oder der monetäre Wert des Finanzinstruments. Für Spread Bets entspricht die Menge des monetären Werts der Wette pro Punkt der Kursbewegung beim zugrunde liegenden Finanzinstrument. Bei einer Erhöhung oder Verringerung des Nennwerts des Derivatekontrakts gibt diese Zahl den absoluten Wert der Veränderung wider und ist als positive Zahl auszudrücken. Für Credit Default Swaps ist die Menge der Nominalbetrag, für den die Absicherung erworben oder veräußert wird.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
37	Restmenge einschließlich nicht sichtbarer Teil	Die Gesamtmenge, die nach einer teilweisen Ausführung oder bei einem anderen Ereignis, das sich auf den Auftrag auswirkt, im Orderbuch verbleibt. Bei einer teilweisen Ausführung des Auftrags ist dies die nach dieser teilweisen Ausführung insgesamt verbleibende Menge. Bei der Eingabe eines Auftrags hat dieser Wert der Anfangsmenge zu entsprechen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
38	Angezeigte Menge	Die im Orderbuch sichtbare Menge (im Gegensatz zur nicht sichtbaren Menge)	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
39	Gehandelte Menge	Wenn es sich um eine teilweise oder vollständige Ausführung handelt, ist in diesem Feld die ausgeführte Menge anzugeben.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
40	Minimum Acceptable Quantity (MAQ)	Die akzeptierte kleinste Menge für einen auszuführenden Auftrag, die sich aus mehreren teilweisen Ausführungen zusammensetzen kann und normalerweise nur für nicht persistente Auftragsarten gilt. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
41	Minimum Executable Size (MES)	Die Mindestausführungsgröße einer einzelnen potenziellen Ausführung. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
42	MES nur erste Ausführung	Gibt an, ob die MES nur für die erste Ausführung relevant ist. Wenn kein Eintrag in Feld 41 erfolgt, kann auch dieses Feld leer bleiben.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
43	Kennzeichen für nur passiv	Gibt an, ob der Auftrag mit einem Merkmal/Kennzeichen an den Handelsplatz übermittelt wird, das festlegt, dass der Auftrag nicht sofort gegen sichtbare Gegenaufträge ausgeführt werden soll.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
44	Kennzeichen für passiv oder aggressiv	Gibt bei der teilweisen oder vollständigen Auftragsausführung an, ob der Auftrag bereits im Orderbuch vorhanden war und der Liquiditätszufuhr dient (passiv) oder ob der Auftrag den Handel auslöste und somit Liquidität abschöpfte (aggressiv). Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	„PASV“ — passiv oder „AGRE“ — aggressiv
45	Self-Execution Prevention	Gibt an, ob der Auftrag mit Kriterien zur Verhinderung der Selbstauftragung eingegeben wurde, damit er nicht gegen einen Auftrag auf der Gegenseite des Buchs ausführbar ist, der vom selben Mitglied oder Teilnehmer eingegeben wurde.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
46	Identifikationscode für Strategieorder	Ein alphanumerischer Code, mit dem alle verbundenen Aufträge, die Teil einer Strategie gemäß Artikel 7 Absatz 2 sind, verknüpft werden.	{ALPHANUM-50}
47	Weiterleitungsstrategie	Die anwendbare Weiterleitungsstrategie gemäß der Spezifikation durch den Handelsplatz. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{ALPHANUM-50}
48	Vom Handelsplatz vergebener Transaktionsidentifikationscode	Alphanumerischer Code, den der Handelsplatz der Transaktion gemäß Artikel 12 der vorliegenden Verordnung zuweist. Der vom Handelsplatz vergebene Transaktionsidentifikationscode muss für jeden Segment MIC nach ISO 10383 und jeden Handelstag eindeutig, konsistent und persistent sein. Verwendet der Handelsplatz keine Segment MICs, muss der Transaktionsidentifikationscode für jeden Operating MIC und Handelstag eindeutig, konsistent und persistent sein. Die Komponenten des Transaktionsidentifikationscodes dürfen die Identität der Gegenparteien der Transaktion, für die der Code geführt wird, nicht offenbaren.	{ALPHANUM-52}

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
-----	------	--	---

Abschnitt K — Handelsphasen, indikativer Auktionspreis und indikatives Auktionsvolumen

49	Handelsphasen	Die Bezeichnung der verschiedenen Handelsphasen, während deren ein Auftrag im Orderbuch vorhanden ist, einschließlich Handelseinstellungen, Notfallsicherungen und Aussetzungen.	{ALPHANUM-50}
50	Indikativer Auktionspreis	Der Preis, zu dem jede Auktion in Bezug auf das Finanzinstrument, für das ein oder mehrere Aufträge platziert wurden, auszugleichen ist.	<p>{DECIMAL-18/5}, falls der Preis als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p>
51	Indikatives Auktionsvolumen	Das Volumen (Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments), das zum indikativen Auktionspreis in Feld 50 ausgeführt werden kann, falls die Auktion zu genau diesem Zeitpunkt enden würde	<p>{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird</p> <p>{DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird</p>