KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/580,

24. juuni 2016,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentidega seotud korralduste asjaomaste andmete säilitamist

(EMPs kohaldatav tekst)

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrust (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012, ([1]) eriti selle artikli 25 lõike 3 neljandat lõiku,

ning arvestades järgmist:

(1) Kauplemiskoha korraldajatel peaks olema võimalus määrata kindlaks, mil viisil nad säilitavad finantsinstrumentidega seotud kõigi korralduste asjaomaseid andmeid. Selleks et oleks võimalik asjakohaseid korralduste andmeid turujärelevalve eesmärgil tulemuslikult ja tõhusalt kõrvutada, võrrelda ja analüüsida, tuleks selline teave teha pädevatele asutustele kättesaadavaks vastavalt ühtsetele normidele ja vormingule, kui pädevad asutused sellist teavet määruse (EL) nr 600/2014 artikli 25 lõike 2 kohaselt taotlevad.

(2) Selguse ja õiguskindluse tagamiseks ning sama teabe topeltsäilitamise vältimiseks peaks käesolev määrus hõlmama kõiki korraldustega seotud andmeelemente, sealhulgas artikli 26 lõigete 1 ja 3 kohaselt esitatavaid andmeid.

(3) Selleks et teha kindlaks ja uurida võimalikke turukuritarvitusi või turukuritarvituse katseid, peavad pädevad asutused kiiresti tuvastama isikud ja üksused, kes võivad märkimisväärselt olla seotud korraldustega, sealhulgas kauplemiskohtade liikmed või osalised, investeerimis- ja täitmisotsuste eest vastutavad üksused, korraldusi mittetäitvad maaklerid ja kliendid, kelle nimel korraldused esitati. Seega peaksid kauplemiskohtade korraldajad selliste isikute andmed säilitama.

(4) Selleks et pädevad asutused saaksid tõhusamalt kindlaks teha ühe kliendi võimalikule kuritarvituslikule käitumisele osutavaid kahtlasi tegevusmustreid (sealhulgas juhul, kui klient tegutseb paljude investeerimisühingute kaudu), peaksid kauplemiskohtade korraldajad säilitama selliste klientide andmed, kelle nimel nende liikmed või osalised korralduse esitasid. Korraldajad peaksid määrama kõnealustele klientidele kordumatu tunnuskoodi, et hõlbustada selliste isikute kindlat ja tõhusat tuvastamist ning seeläbi tõhustada selliste võimalike turu kuritarvituste analüüsi, millega kliendid võivad olla seotud.

(5) Kauplemiskohtade korraldajad ei peaks säilitama andmeid kõikide kauplemisahela klientide kohta, vaid üksnes klientide kohta, kelle nimel liikmed või osalised korralduse esitasid.

(6) Turuga manipuleerimise tõhusaks avastamiseks on oluline tuvastada turutegemise strateegiad või samalaadsed tegevused. See võimaldab pädevatel asutustel eristada korraldusi, mille esitavad investeerimisühingud, kes tegutsevad korralduse aluseks oleva instrumendi emitendi või kauplemiskoha, kellele korraldus esitatakse, eelnevalt kindlaks määratud tingimustel, korraldustest, mille esitab investeerimisühing oma või kliendi kaalutlusõiguse alusel.

(7) Säilitada tuleks mis tahes korralduse esitamise, muutmise, tühistamise, tagasilükkamise ja täitmise andmed, sealhulgas täpne kuupäev ja kellaaeg. See võimaldab jälgida korralduse muutusi selle kehtivusaja jooksul, mis võib märkimisväärselt hõlbustada võimaliku turuga manipuleerimise ja tehingueelse käitumise avastamist ja hindamist.

([1]) ELT L 173, 12.6.2014, lk 84.

(8) Selleks et tagada täpne ja täielik ülevaade kauplemiskoha tellimusraamatust, nõuavad pädevad asutused teavet kauplemisperioodide kohta, mille jooksul finantsinstrumentidega kaubeldakse. Selle teabe alusel saab eelkõige kindlaks määrata, millal oksjoniperioodid või pidevkauplemine algavad ja lõpevad ning kas korraldused põhjustavad kavandamata kauplemispiiranguid. Seda teavet on vaja ka selleks, et teha kindlaks korralduste koostoime, eelkõige juhul, kui kauplemisperioodid lõpevad juhuperioodidega nagu oksjonid. Teave indikatiivsete sobitamishindade ja -mahtude kohta aitaks analüüsida ka oksjoni võimalikku manipuleerimist. Võttes arvesse, et üksainus korraldus võib mõjutada kas oksjoni sobitamishinda, sobitamismahtu või mõlemat, peab pädevatel asutusel olema võimalik hinnata iga korralduse mõju nendele väärtustele. Ilma sellise teabeta oleks keeruline teha kindlaks, milline korraldus neid väärtusi mõjutas. Lisaks tuleks igale korraldust mõjutavale sündmusele määrata järjenumber, et määrata kindlaks sündmuste järjekord juhul, kui kaks või enam sündmust toimuvad samal ajal.

(9) Tellimusraamatus korralduste järjekoha kindlaksmääramine võimaldab tellimusraamatu sisu taastada ja korralduste täitmise järjekorda analüüsida, mis on turu kuritarvituste seire oluline element. Korraldusele määratud järjekoht sõltub sellest, kuidas kauplemissüsteem prioriteetsuse määrab. Seepärast peaksid kauplemiskoha korraldajad määrama korralduste prioriteetsuse ja säilitama selle kohta andmed vastavalt hinna-nähtavuse-ajapõhise prioriteetsuse või mahu-ajapõhise prioriteetsuse meetodile.

(10) Tõhusa turujärelevalve tagamiseks peab olema võimalik siduda korraldused vastavate tehingutega. Seepärast peaksid kauplemiskohtade korraldajad säilitama eriomased tehingu tunnuskoodid, millega seotakse korraldused tehingutega.

(11) Kauplemiskohtade korraldajad peaksid iga saadud korralduse puhul vastavalt nende oma liigitusele säilitama andmed korralduse liigi ja seotud erijuhiste kohta, mis koos määravad, kuidas iga korraldust sobitamissüsteemis käsitletakse. Selline üksikasjalik teave on esmatähtis, et pädevad asutused saaksid turu kuritarvituste seire osana jälgida kauplemistegevust asjaomases kauplemiskoha tellimusraamatus ja eelkõige jäljendada, kuidas iga korraldus tellimusraamatus toimib. Võttes arvesse laia valikut kauplemiskohtade korraldajate kasutatavaid olemasolevaid ja võimalikke uusi korralduste liike ning nende eriomadusi, ei pruugi sellise üksikasjaliku teabe säilitamine vastavalt korraldajasisesele liigitamissüsteemile võimaldada pädevatel asutustel praegu tellimisraamatuga seotud tegevust kõigi kauplemiskohtade puhul ühtselt jäljendada. Selleks et pädevad asutused saaksid täpselt kindlaks teha iga tellimusraamatus oleva korralduse, peaksid kauplemiskohtade korraldajad liigitama iga saadud korralduse kas määratud hinnaga korralduseks (kui korraldus on kaubeldav) või stopp-korralduseks (kui korraldus muutub kaubeldavaks üksnes pärast eelnevalt kindlaks määratud hinnasündmuse realiseerumist).

(12) Ühtsuse huvides ja finantsturgude sujuva toimimise tagamiseks on vaja, et käesoleva määruse sätteid ja määruse (EL) nr 600/2014 sätteid hakataks kohaldama samast kuupäevast.

(13) Käesolev määrus põhineb regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul, mille on komisjonile esitanud Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve (ESMA).

(14) ESMA on korraldanud avalikud konsultatsioonid käesoleva määruse aluseks oleva regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta, analüüsinud potentsiaalseid seonduvaid kulusid ja tulusid ning küsinud Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ([1]) artikli 37 kohaselt moodustatud väärtpaberituru sidusrühmade kogu arvamust,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Asjakohaste korralduste andmete ulatus, normid ja vorming

1. Kauplemiskoha korraldaja säilitab pädevale asutusele kättesaadavana artiklites 2–13 sätestatud ning lisa tabeli 2 teises ja kolmandas veerus täpsustatud andmed iga nende süsteemide kaudu teatavaks tehtud korralduse kohta, kuivõrd kõnealused andmed on konkreetse korralduse puhul asjakohased.

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

2. Kui pädev asutus lõikes 1 osutatud mis tahes andmeid vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artikli 25 lõikele 2 taotleb, esitavad kauplemiskoha korraldajad sellised andmed vastavalt käesoleva määruse lisa tabeli 2 neljandas veerus kindlaks määratud normidele ja vormingule.

Artikkel 2

Asjaomaste poolte tunnusandmed

1. Kõikide korralduste puhul säilitavad kauplemiskoha korraldajad andmed järgmise kohta:

(a) kauplemiskoha liige või osaline, kes esitas korralduse kauplemiskohale, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 1;

(b) kauplemiskoha, millele korraldus esitati, liikme või osalise raames isik või arvutialgoritm, kes/mis vastutab korraldusega seotud investeerimisotsuse eest, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 4;

(c) kauplemiskoha liikme või osalise raames isik või arvutialgoritm, kes/mis vastutab korralduse täitmise eest, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 5;

(d) kauplemiskoha liige või osaline, kes kauplemiskoha teise liikme või osalise nimel korralduse suunas, tähistatakse tehinguid mittetäitva maaklerina, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 6;

(e) klient, kelle nimel kauplemiskoha liige või osaline esitas korralduse kauplemiskohale, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 3.

2. Kui kauplemiskoha liikmel või osalisel või kliendil on liikmesriigi õiguse kohaselt lubatud pärast korralduse kauplemiskohale esitamist määrata korraldus oma kliendile ning ta ei ole korralduse esitamise ajal korraldust veel kliendile määranud, tähistatakse kõnealune korraldus, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 3.

3. Kui kauplemiskohale esitatakse mitu korraldust koondkorraldusena, tähistatakse koondkorraldus vastavalt lisa tabeli 2 andmeväljale 3.

Artikkel 3

Kauplemiskoha korraldaja liikmete või osaliste kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine

1. Kauplemisvolitusi, mille alusel kauplemiskoha korraldaja liige või osaline korralduse esitab, kirjeldatakse lisa tabeli 2 andmeväljal 7 kindlaks määratud viisil.

2. Järgmised korraldused esitatakse lisa tabeli 2 andmevälja 8 kohaselt:

a) korraldus, mille on kauplemiskohale esitanud liige või osaline Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL ([1]) artiklite 17 ja 48 kohase turutegemise strateegia osana;

b) korraldus, mille on kauplemiskohale esitanud liige või osaline mis tahes muu likviidsuse pakkumise tegevuse osana, mida teostatakse tingimustel, mille on eelnevalt kindlaks määranud korralduse aluseks oleva instrumendi emitent või kõnealune kauplemiskoht.

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).

Artikkel 4

Kuupäeva ja kellaaja kajastamine

1. Kauplemiskohtade korraldajad säilitavad teabe käesoleva määruse lisa tabeli 2 andmeväljal 21 loetletud iga sündmuse toimumise kuupäeva ja kellaaja kohta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 ([1]) artiklis 2 kindlaks määratud täpsusega, nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse lisa tabeli 2 andmeväljal 9. Välja arvatud kauplemiskoha süsteemide poolt korralduste tagasilükkamise kuupäev ja kellaaeg, säilitatakse teave kõigi käesoleva määruse lisa tabeli 2 andmeväljal 21 osutatud sündmuste toimumise kuupäeva ja kellaaja kohta, kasutades kauplemiskoha sobitamissüsteemi äritegevuses kasutatavaid kellasid.

2. Kauplemiskohtade korraldajad säilitavad teabe käesoleva määruse lisa tabeli 2 andmeväljadel 49, 50 ja 51 loetletud iga andmeelemendi kuupäeva ja kellaaja kohta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 2 kindlaks määratud täpsusega.

Artikkel 5

Kehtivusaeg ja tehingupiirangud

1. Kauplemiskohtade korraldajad säilitavad andmed kehtivusaja ja tehingupiirangute kohta, mis on loetletud lisa tabeli 2 andmeväljadel 10 ja 11.

2. Teave kehtivusaegade kuupäevade ja kellaaegade kohta säilitatakse iga kehtivusaja puhul vastavalt lisa tabeli 2 andmeväljale 12.

Artikkel 6

Prioriteetsus ja järjenumbrid

1. Kauplemiskohtade korraldajad, kes korraldavad kauplemissüsteeme hinna-nähtavuse-ajapõhise prioriteetsuse alusel, säilitavad prioriteetsuse ajatempli andmed kõigi korralduste puhul, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 13. Prioriteetsuse ajatempel säilitatakse sama täpselt, nagu on sätestatud artikli 4 lõikes 1.

2. Kauplemiskohtade korraldajad, kes korraldavad kauplemissüsteeme mahu-ajapõhise prioriteetsuse alusel, säilitavad prioriteetsuse määramisel aluseks võetud koguse andmed, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 14, ja lõikes 1 osutatud prioriteetsuse ajatempli andmed.

3. Kauplemiskohtade korraldajad, kes kasutavad hinna-nähtavuse-ajapõhise prioriteetsuse ja mahu-ajapõhise prioriteetsuse kombinatsiooni ning kajastavad korraldusi oma tellimusraamatus ajapõhise prioriteetsuse alusel, järgivad lõiget 1.

4. Kauplemiskohtade korraldajad, kes kasutavad hinna-nähtavuse-ajapõhise prioriteetsuse ja mahu-ajapõhise prioriteetsuse kombinatsiooni ning kajastavad korraldusi oma tellimusraamatus mahu-ajapõhise prioriteetsuse alusel, järgivad lõiget 2.

5. Kauplemiskoha korraldajad säilitavad järjenumbri kõigi sündmuste puhul, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 15.

Artikkel 7

Finantsinstrumentidega seotud korralduste tunnuskoodid

1. Kauplemiskoha korraldajad säilitavad iga korralduse puhul individuaalse tunnuskoodi, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 20. Tunnuskood peab olema iga tellimisraamatu, kauplemispäeva ja finantsinstrumendi puhul kordumatu. Seda kohaldatakse kauplemiskoha korraldaja poolt korralduse saamise hetkest kuni korralduse kõrvaldamiseni tellimusraamatust. Tunnuskood määratakse ka tagasilükatud korraldustele, sõltumata tagasilükkamise põhjustest.

([1]) Komisjoni 7. juuni 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/574, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL seoses äritegevuses kasutatavate kellade täpsust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega (vt käesoleva *Euroopa Liidu Teataja* lk 148).

2. Kauplemiskoha korraldaja säilitab tuletamisfunktsionaalsusega strateegiapõhiste korralduste asjakohased andmed, mis avalikustatakse vastavalt lisale. Lisa tabeli 2 andmeväli 33 hõlmab märget selle kohta, et korraldus on kaudne korraldus.

Tuletamisfunktsionaalsusega strateegiapõhise korralduse täitmise korral säilitab kauplemiskoha korraldaja selle andmed vastavalt lisale.

Tuletamisfunktsionaalsusega strateegiapõhise korralduse täitmise korral märgitakse strateegiapõhise korralduse tunnuskood, kasutades sama tunnuskoodi kõigi konkreetse strateegiaga seotud korralduste puhul. Strateegiapõhise korralduse tunnuskood on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 46.

3. Kauplemiskohale esitatud korraldused, mille puhul on lubatud kasutada suunamisstrateegiat ja mis on suunatud teisele kauplemiskohale, tähistab kauplemiskoht märkega „suunatud“, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 33. Kauplemiskohale esitatud korraldustel, mille puhul on lubatud kasutada suunamisstrateegiat, on kogu nende kehtivusajal sama tunnuskood, olenemata sellest, kas järelejäänud kogus sisestati tellimusraamatusse uuesti.

Artikkel 8

Finantsinstrumentidega seotud korraldusi mõjutavad sündmused

Kauplemiskoha korraldajad säilitavad seoses uute korraldustega lisa tabeli 2 andmeväljal 21 osutatud andmed.

Artikkel 9

Finantsinstrumentidega seotud korralduse liik

1. Kauplemiskoha korraldajad säilitavad iga saadud korralduse puhul korralduse liigi andmed, kasutades oma liigitust, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 22.

2. Kauplemiskoha korraldajad liigitavad iga saadud korralduse kas määratud hinnaga korralduseks või stopp-korralduseks, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 andmeväljal 23.

Artikkel 10

Korraldustega seotud hinnad

Kauplemiskoha korraldajad säilitavad kõik lisa tabeli 2 I jaos osutatud hinnaandmed, kuivõrd need on korralduste puhul asjakohased.

Artikkel 11

Korraldusega seotud juhised

Kauplemiskoha korraldajad säilitavad iga korralduse puhul saadud juhiste andmed, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 J jaos.

Artikkel 12

Kauplemiskoha tehingu tunnuskood

Kauplemiskoha korraldajad säilitavad korralduse täielikust või osalisest täitmisest tuleneva iga tehingu puhul individuaalse tehingu tunnuskoodi, nagu on kindlaks määratud lisa tabeli 2 tekstiväljal 48.

Artikkel 13

Kauplemisetapid ning indikatiivne oksjoni hind ja maht

1. Kauplemiskoha korraldajad säilitavad lisa tabeli 2 K jaos kindlaks määratud korralduste andmed.

2. Kui pädev asutus vastavalt artiklile 1 taotleb K jaos osutatud andmeid, loetakse kõnealuse taotlusega seotud korraldusandmete puhul asjakohasteks ka lisa tabeli 2 andeväljadel 9 ja 15–18 osutatud andmeid.

Artikkel 14

Jõustumine ja kohaldamine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Seda kohaldatakse alates määruse (EL) nr 600/2014 artikli 55 teises lõigus osutatud kuupäevast.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 24. juuni 2016

Komisjoni nimel

president

Jean-Claude JUNCKER

LISA

Tabel 1

Tabeli 2 selgitus

TÄHIS	ANDMETE LIIK	MÄÄRATLUS
{ALPHANUM-n}	Kuni n tähtnumbrilist märki	Vabateksti väli.
{CURRENCYCODE_3}	3 tähtnumbrilist märki	kolmetäheline valuutakood (ISO 4217 valuutakood)
{DATE_TIME_FORMAT}	ISO 8601 vormingus kuupäev ja kellaaeg	Kuupäev ja kellaaeg järgnevas vormingus: AAAA-KK-PPTtt:mm:ss.dddddd Z. — „AAAA“ tähistab aastat; — „KK“ kuud; — „PP“ päeva; — „T“ tähendab, et kellaaja ette tuleb kirjutada täht „T“ — „tt“ tähistab tunde; — „mm“ minuteid; — „ss.dddddd“ sekundit ja selle murdosi; — Z tähistab UTC kellaaega. Kuupäevad ja kellaajad esitatakse UTC kohaselt.
{DATEFORMAT}	ISO 8601 kuupäevavorming	Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAA-KK-PP
{DECIMAL-n/m}	Kuni n kümnendkohta, millest m kohta võivad olla murdarvud	Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne arv. — kümnendkohtade eraldusmärk on punkt; — negatiivsete arvude ees on miinusmärk; — väärtused ümardatakse, neid ei kärbita.
{INTEGER-n}	Täisarv kuni n kohta	Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne arv.
{ISIN}	12 tähtnumbrilist märki	ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166
{LEI}	20 tähtnumbrilist märki	Juriidilise isiku tunnus, nagu on määratletud standardis ISO 17442.
{MIC}	4 tähtnumbrilist märki	Turu tunnuskood, nagu on määratletud standardis ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 tähtnumbrilist märki	Tunnuskood, nagu on määratletud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 [1] artiklis 6 ja II lisas.

[1] Komisjoni 28. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist (vt käesoleva *Euroopa Liidu Teataja* lk 449).

Tabel 2

Korralduste andmed

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	Kauplemiskoha liikme või osalise tunnusandmed. Otsese elektroonilise juurdepääsu puhul ühe otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja tunnusandmed.	{LEI}
2	Otsene elektrooniline juurdepääs	„õige“ – kui korraldus esitati kauplemiskohale direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punktis 41 määratletud otsese elektroonilise juurdepääsu kaudu; „vale“ – kui korraldust ei esitatud kauplemiskohale direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punktis 41 määratletud otsese elektroonilise juurdepääsu kaudu.	„õige“ „vale“
3	Kliendi tunnuskood	Kauplemiskoha liikme või osalise tunnuskood. Otsese elektroonilise juurdepääsu puhul kasutatakse otsese elektroonilise juurdepääsu kasutaja tunnuskoodi. Kui klient on juriidiline isik, märgitakse kliendi juriidilise isiku tunnus. Kui klient ei ole juriidiline isik, märgitakse riiklik tunnuskood {NATIONAL_ID}. Koondatud korralduste puhul kasutatakse tähist AGGR, nagu on sätestatud käesoleva määruse artikli 2 lõikes 3. Pooleliolevate määramiste puhul kasutatakse tähist PNAL, nagu on sätestatud käesoleva määruse artikli 2 lõikes 2. See andmeväli jäetakse tühjaks üksnes juhul, kui kauplemiskoha liikmel või osalisel ei ole kliente.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR“ – koondatud korraldused „PNAL“ – pooleliolevad määramised
4	Ettevõttesisene investeerimisotsus	Kauplemiskoha liikme või osalise raames sellise isiku või algoritmi tunnuskood, kes vastutab investeerimisotsuse eest, vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 8. Kui investeerimisotsuse eest vastutavad kauplemiskoha liikme või osalise raames füüsilised isikud, märgitakse investeerimisotsuse eest vastutava või peamiselt vastutava isiku riiklik tunnuskood. Kui investeerimisotsuse tegi algoritm, täidetakse andmeväli vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 8. See andmeväli jäetakse tühjaks, kui investeerimisotsust ei teinud kauplemiskoha liikme või osalise raames füüsiline isik ega algoritm.	{NATIONAL_ID} – füüsilised isikud {ALPHANUM-50} – algoritmid
5	Ettevõttesisene täitmine	Kauplemiskoha liikme või osalise raames sellise isiku või algoritmi tunnuskood, kes vastutab korraldusest tuleneva tehingu täitmise eest, vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 9. Kui tehingu täitmise eest vastutab füüsiline isik, märgitakse isiku riiklik tunnuskood {NATIONAL_ID}.	{NATIONAL_ID} – füüsilised isikud {ALPHANUM-50} – algoritmid

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Kui tehingu täitis algoritm, täidetakse andmeväli vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 9. Kui tehingu täitmises osaleb mitu isikut või isikute ja algoritmide kominatsioon, määrab kauplemiskoha liige, osaline või klient peamiselt vastutava kaupleja või algoritmi, nagu on kindlaks määratud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 9 lõikes 4, ja märgib sellele andmeväljale kõnealuse kaupleja või algoritmi tunnuskoodi.	
6	Tehinguid mittetäitev maakler	Vastavalt artikli 2 punktile d. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{LEI}

B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine

7	Kauplemisvolitused	Märgitakse, kas korralduse esitamine tuleneb kauplemiskoha liikmelt või osaliselt, kes tegi direktiivi 2014/65/EL artikli 4 punkti 38 kohase kliendikorralduste sobitamistehingu või kauples direktiivi 2014/65/EL artikli 4 punkti 6 kohaselt oma arvel. Kui korralduse esitamine ei tulene kauplemiskoha liikmelt või osaliselt, kes tegi kliendikorralduste sobitamistehingu või kauples oma arvel, märgitakse andmeväljal, et tehing tehti muu volituse alusel.	„DEAL“ – kauplemine oma arvel „MTCH“ – kliendikorralduste sobitamine „AOTC“ – mis tahes muu volituse alusel
8	Likviidsuse pakkumine	Märgitakse, kas korraldus esitati kauplemiskohale direktiivi 2014/65/EL artiklite 17 ja 48 kohase turutegemise strateegia või muu tegevuse osana vastavalt käesoleva määruse artiklile 3.	„õige“ „vale“

C jagu – kuupäev ja kellaaeg

9	Kuupäev ja kellaaeg	G ja K jagudes loetletud iga sündmuse kuupäev ja kellaaeg.	{DATE_TIME_FORMAT} Sekundite kümnendkohtade arv määratakse kindaks vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklile 2.

D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud

10	Kehtivusaeg	Kehtib päeva jooksul (*Good-For-Day*): korraldus kaotab kehtivuse selle kauplemispäeva lõpus, mil ta tellimusraamatusse kanti.	„DAVY“ – kehtib päeva jooksul
		Kehtib kuni tühistamiseni (*Good-Till-Cancelled*): korraldus on tellimusraamatus aktiivne ja täidetav kuni selle tühistamiseni.	„GTCV“ – kehtib kuni tühistamiseni

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Kehtib kuni kellaajani (*Good-Till-Time*): korraldus kaotab kehtivuse hiljemalt eelnevalt kindlaks määratud ajal jooksval kauplemisperioodil.	„GTTV“ – kehtib kuni kellaajani
		Kehtib kuni kuupäevani (*Good-Till-Date*): korraldus kaotab kehtivuse kindlaks määratud kuupäeva lõpus.	„GTDV“ – kehtib kuni kuupäevani
		Kehtib kuni kindlaks määratud kuupäeva ja kellaajani (*Good-Till-Specified Date and Time*): korraldus kaotab kehtivuse kindlaks määratud kuupäeval ja kellaajal.	„GTSV“ – kehtib kuni kindlaks määratud kuupäeva ja kellaajani
		Kehtib pärast kellaaega (*Good After Time*): korraldus on aktiivne üksnes pärast eelnevalt kindlaks määratud kellaaega jooksval kauplemisperioodil.	„GATV“ – kehtib pärast kellaaega
		Kehtib pärast kuupäeva (*Good After Date*): korraldus on aktiivne üksnes alates eelnevalt kindlaks määratud kuupäevast.	„GADV“ – kehtib pärast kuupäeva
		Kehtib pärast kindlaks määratud kuupäeva ja kellaaega (*Good After Specified Date and Time*): korraldus on aktiivne üksnes alates eelnevalt kindlaks määratud kuupäeva teatavast kellaajast.	„GASV“ – kehtib pärast kindlaks määratud kuupäeva ja kellaaega
		Täida või tühista kohe (*Immediate-Or-Cancel*): korraldus, mis täidetakse tellimusraamatusse kandmisel (koguses, mida saab täita) ja mille järelejäänud koguse (kui seda on) kajastamine tellimusraamatus lõpetatakse.	„IOCV“ – täida või tühista kohe
		Täida või tühista (*Fill-Or-Kill*): korraldus, mis täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tingimusel et seda on võimalik täielikult täita. Kui korraldust on võimalik täita ainult osaliselt, lükatakse see automaatselt tagasi ja seega seda ei täideta.	„FOKV“ – täida või tühista või {ALPHANUM-4} tähtnumbrilised märgid, mis ei ole kauplemiskoha liigitussüsteemis juba kasutusel.
		Muud: konkreetsele ärimudelile, kauplemisplatvormile või -süsteemile omased muud täiendavad näitajad.	
11	Tehingupiirangud	Kehtib sulgemishinna ristumisperioodi puhul: kui korraldus kvalifitseerub sulgemishinna ristumisperioodiks.	„SESR“ – kehtib sulgemishinna ristumisperioodi puhul
		Kehtib oksjoni puhul: korraldus on aktiivne ja täidetav üksnes oksjonietapis (mille võib eelnevalt kindlaks määrata kauplemiskoha liige või osaline, kes korralduse esitas, nt avaoksjonid ja sulgemisoksjonid või päevasisesed oksjonid).	„VFAR“ – kehtib oksjoni puhul
		Kehtib üksnes pidevkauplemise puhul: korraldus on aktiivne üksnes pidevkauplemisperioodil.	„VFCR“ – kehtib üksnes pidevkauplemise puhul

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Muud: konkreetsele ärimudelile, kauplemisplatvormile või -süsteemile omased muud täiendavad näitajad.	{ALPHANUM-4} tähtnumbrilised märgid, mis ei ole kauplemiskoha liigitussüsteemis juba kasutusel. Kui asjakohased on mitu näitajat, märgitakse andmeväljale mitu tähist, mis eraldatakse komaga.
12	Kehtivusperiood ja kellaaeg	Ajatempel, mis kajastab aega, mil korraldus muutub aktiivseks või see kõrvaldatakse tellimusraamatust. Kehtib päeva jooksul: tellimisraamatusse kandmise kuupäev ajatempliga vahetult enne kesköö. Kehtib kuni kellaajani: tellimisraamatusse kandmise kuupäev koos korralduses märgitud kellaajaga. Kehtib kuni kuupäevani: kindlaks määratud kehtivuse kaotamise kuupäev ajatempliga vahetult enne kesköö. Kehtib kuni kindlaks määratud kuupäeva ja kellaajani: kindlaks määratud kehtivuse kaotamise kuupäev ja kellaaeg. Kehtib pärast kellaaega: tellimisraamatusse kandmise kuupäev ja kindlaks määratud kellaaeg, mil korraldus muutub aktiivseks. Kehtib pärast kuupäeva: kindlaks määratud kuupäev ajatempliga vahetult pärast kesköö. Kehtib pärast kindlaks määratud kuupäeva ja kellaaega: kindlaks määratud kuupäev ja kellaaeg, mil korraldus muutub aktiivseks. Kehtib kuni tühistamiseni: lõplik kuupäev ja kellaaeg, mil korraldus turutoimingute kaudu automaatselt kõrvaldatakse. Muud: mis tahes täiendava kehtivusliigi ajatempel.	{DATE_TIME_FORMAT} Sekundite kümnendkohtade arv määratakse kindaks vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklile 2.

E jagu – prioriteetsus ja järjenumber

13	Prioriteetsuse ajatempel	Seda andmevälja ajakohastatakse iga kord, kui korralduse prioriteetsus muutub.	{DATE_TIME_FORMAT} Sekundite kümnendkohtade arv määratakse kindaks vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklile 2.
14	Prioriteetsuspõhine kogus	Mahu-ajapõhist prioriteetsust kasutavate kauplemiskohtade puhul märgitakse sellele andmeväljale kogusele vastav positiivne arv. Seda andmevälja ajakohastatakse iga kord, kui korralduse prioriteetsus muutub.	Kuni 20 positiivset numbrit.
15	Järjenumber	Iga G jaos loetletud sündmus tähistatakse positiivse täisarvuga kasvavas järjestuses. Järjenumber on iga sündmuse liigi puhul kordumatu. See on ühtne kauplemiskoha korraldaja ajatempliga märgitud kõigi sündmuste lõikes ja muutumatu sündmuse toimumise kuupäeva puhul.	{INTEGER-50}

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	Sellise kauplemiskoha tunnuskood, kus korraldus esitati. Kui kauplemiskoht kasutab segmendi MICi, märgitakse segmendi MIC. Kui kauplemiskoht ei kasuta segmendi MICi, märgitakse korraldaja MIC.	{MIC}
17	Tellimusraamatu tunnuskood	Kauplemiskoha poolt igale tellimusraamatule määratud tähtnumbriline tunnuskood.	{ALPHANUM-20}
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	Finantsinstrumendi kordumatu ja selge tunnuskood.	{ISIN}
19	Kättesaamise kuupäev	Algse korralduse kättesaamise kuupäev.	{DATEFORMAT}
20	Korralduse tunnuskood	Kauplemiskoha korraldaja poolt konkreetsele korraldusele määratud tähtnumbriline tunnuskood.	{ALPHANUM-50}
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	Uus korraldus: kauplemiskoha korraldaja saab uue korralduse.	„NEWO“ – uus korraldus
		Käivitatud: korraldus, mis muutub täidetavaks või vajaduse korral mittetäidetavaks eelnevalt kindlaks määratud tingimuse realiseerumisel.	„TRIG“ – käivitatud
		Kauplemiskoha liikme või osalise poolt asendatud: kui kauplemiskoha liige, osaline või klient otsustab omal algatusel muuta tema poolt varem tellimusraamatusse kantud korralduse andmeid.	„REME“ – kauplemiskoha liikme või osalise poolt asendatud
		Turutoimingute poolt asendatud (automaatne): kui kauplemiskoha korraldaja IT-süsteemid on muutnud korralduse andmeid. See hõlmab juhtusid, kui muudetud on seotud hinnatasemega korralduse või liikuva stopp-korralduse andmeid, et kajastada seda, kus korraldus tellimusraamatus asub.	„REMA“ – turutoimingute poolt asendatud (automaatne)
		Turutoimingute poolt asendatud (inimsekkumine): kui kauplemiskoha korraldaja töötajad on muutnud korralduse andmeid. See hõlmab juhtusid, kui kauplemiskoha liikmel, osalisel või kliendil on IT-probleeme, mistõttu on vaja korraldused kiiresti tühistada.	„REMH“ – turutoimingute poolt asendatud (inimsekkumine)
		Seisundi muutmine kauplemiskoha liikme/osalise algatusel. See hõlmab aktiveerimist ja desaktiveerimist.	„CHME“ – seisundi muutmine kauplemiskoha liikme/osalise algatusel

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Seisundi muutmine turutoimingute poolt.	„CHMO“ – seisundi muutmine turutoimingute poolt
		Tühistatud kauplemiskoha liikme või osalise algatusel: kui liige, osaline või klient omal algatusel otsustab tühistada tema poolt varem tellimusraamatusse kantud korralduse.	„CAME“ – tühistatud kauplemiskoha liikme või osalise algatusel
		Tühistatud turutoimingute poolt. See hõlmab selliste investeerimisühingute kaitsemehhanismi, kes rakendavad direktiivi 2014/65/EL artiklite 17 ja 48 kohast turutegemise strateegiat.	„CAMO“ – tühistatud turutoimingute poolt
		Tagasi lükatud korraldus: kauplemiskoha korraldaja saadud, kuid tagasi lükatud korraldus.	„REMO“ – tagasi lükatud korraldus
		Kehtivuse kaotanud korraldus: kui korraldus on pärast selle kehtivusaega tellimusraamatust kõrvaldatud.	„EXPI“ – kehtivuse kaotanud korraldus
		Osaliselt täidetud: kui korraldus ei ole täielikult täidetud, mistõttu teatav kogus kuulub veel täitmisele.	„PARF“ – osaliselt täidetud
		Täidetud: kui ei ole jäänud täitmisele kuuluvat kogust.	„FILL“ – täidetud {ALPHANUM-4} tähtnumbrilised märgid, mis ei ole kauplemiskoha liigitussüsteemis juba kasutusel.

H jagu – korralduse liik

22	Korralduse liik	Kauplemiskohale esitatud korralduse liik vastavalt kauplemiskoha normidele.	{ALPHANUM-50}
23	Korralduse liigitus	Korralduse liigitus vastavalt kahele põhiliigile: Määratud hinnaga korraldus: kui korraldus on kaubeldav ja stopp-korraldus: kui korraldus muutub kaubeldavaks üksnes pärast eelnevalt kindlaks määratud hinnasündmuse realiseerumist.	Määratud hinnaga korralduse puhul märkida tähis „LMTO“ ja stopp-korralduse puhul „STOP“.

I jagu – hinnad

24	Määratud hind	Maksimumhind, mille puhul saab ostukorralduse alusel kaubelda, või miinimumhind, mille puhul saab müügikorralduse alusel kaubelda. Strateegiapõhiste korralduste puhul hinnavahe. See võib olla negatiivne või positiivne.	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus.

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Korralduste puhul, millel ei ole määratud hinda, ja mis tahes hinnata korralduste puhul jäetakse see andmeväli tühjaks. Vahetusvõlakirjade puhul märgitakse sellele andmeväljale korralduse puhul kasutatud tegelik hind (ilma tuleviku rahavoogudeta või koos tuleviku rahavoogudega).	{DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena. {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides.
25	Täiendav määratud hind	Mis tahes muu määratud hind, mida võidakse korralduse puhul kasutada. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus. {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena. {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides.
26	Stopp-hind	Hind, mis tuleb saavutada, et korraldus muutuks aktiivseks. Stopp-korralduste puhul, mille käivitavad finantsinstrumendi hinnast sõltumatud sündmused, märgitakse sellel andmeväljal stopp-hinnaks null. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus. {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena. {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides.
27	Seotud määratud hind	Maksimumhind, mille puhul saab seotud ostukorralduse alusel kaubelda, või miinimumhind, mille puhul saab seotud müügikorralduse alusel kaubelda. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus. {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena. {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides.

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
28	Tehinguhind	Hind, millega tehing tehti, välja arvatud (kui see on asjakohane) vahendustasu ja kogunenud intressid. Optsioonilepingute puhul märgitakse tuletislepingu hind alusvara või indeksipunkti kohta. Hinnavahekihlvedude puhul märgitakse otseselt alusvaraks oleva instrumendi võrdlushind. Krediidiriski vahetustehingute puhul märgitakse kupongiintress baaspunktides. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus. Kui hind ei ole asjakohane, märgitakse andmeväljale tekst „NOAP“.	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses. {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena. {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides. „NOAP“
29	Hinna valuuta	Valuuta, milles korraldusega seotud finantsinstrumendi tehinguhind on väljendatud (kui hind on väljendatud rahalises väärtuses).	{CURRENCYCODE_3}
30	Poole 2 valuuta	Mitme valuuta või erinevate valuutade intressimäära vahetustehingute puhul on poole 2 valuuta selline valuuta, milles lepingu pool 2 on nomineeritud. Vahetusoptsioonide puhul, mille aluseks on mitme valuuta vahetustehing, on poole 2 valuuta selline valuuta, milles vahetustehingu pool 2 on nomineeritud. Seda andmevälja täidetakse üksnes intressimäära ja valuuta tuletislepingute puhul.	{CURRENCYCODE_3}
31	Hinnanoteering	Märgitakse, kas hind väljendatakse rahalises väärtuses, protsentides, tootlusena või baaspunktides.	„MONE“ – rahaline väärtus „PERC“ – protsentides „YIEL“ – tootlusena „BAPO“ – baaspunktides

J jagu – korraldusega seotud juhised

32	Ostu-müüginäitaja	Näitab, kas tegemist on ostu- või müügikorraldusega. Optsioonide ja vahetusoptsioonide puhul on ostja selline vastaspool, kellel on õigus optsioon realiseerida, ja müüja selline vastaspool, kes müüb optsiooni ja saab optsioonipreemia. Muude futuuride ja forvardite kui valuutafutuurid ja – forvardid puhul on ostja instrumenti ostev vastaspool ja müüja instrumenti müüv vastaspool. Väärtpaberite vahetustehingute puhul on ostja selline vastaspool, kes on avatud alusvaraks oleva väärtpaberi hinnamuutuse riskile ja saab väärtpaberi hinna. Müüja on vastaspool, kes maksab väärtpaberi hinna.	„BUYI“ – ost „SELL“ – müük

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
		Intressimäära või inflatsiooniindeksi vahetustehingute puhul on ostja fikseeritud intressimäära maksev vastaspool. Müüja on fikseeritud intressimäära saav vastaspool. Baasvahetustehingute (ujuv määr ujuva määra vastu vahetustehingud) puhul on ostja intressivahet maksev vastaspool ja müüja intressivahet saav vastaspool. Valuutavahetustehingute ja -forvardite ning erinevate valuutade intressimäära vahetustehingute puhul on ostja selline vastaspool, kes saab valuuta, mis on ISO 4217 standardi kohaselt tähestikulises järjekorras esitatuna tehingu teisest valuutast eespool, ja müüja sellist valuutat üleandev vastaspool. Dividendi vahetustehingute puhul on ostja samaväärseid tegelikke dividendimakseid saav vastaspool. Müüja on dividendi maksev ja fikseeritud intressimäära saav vastaspool. Krediidiriski ülekandmise tuletisinstrumentide (välja arvatud optsioonid ja vahetusoptsioonid) puhul on ostja kaitset ostev vastaspool. Müüja on kaitset müüv vastaspool. Kauba või lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul on ostja aruandes kindaks määratud kauba või lubatud heitkoguste väärtpaberite saaja ning müüja kauba või lubatud heitkoguste väärtpaberite üleandja. Intressiforvardite puhul on ostja fikseeritud intressimäära maksev vastaspool ja müüja fikseeritud intressimäära saav vastaspool. Tingliku väärtuse suurendamise korral on ostja sama nagu algse tehingu raames finantsinstrumendi omandaja ja müüja sama nagu algse tehingu raames finantsinstrumendi võõrandaja. Tingliku väärtuse vähendamise korral on ostja sama nagu algse tehingu raames finantsinstrumendi võõrandaja ja müüja sama nagu algse tehingu raames finantsinstrumendi omandaja.	
33	Korralduse seisund	Märgitakse korraldused, mis on aktiivsed/mitteaktiivsed/peatatud, siduvad/indikatiivsed (üksnes hinnapakkumised)/kaudsed/suunatud. Aktiivne – hinnapakkumiseta korraldused, mis on kaubeldavad. Mitteaktiivne – hinnapakkumiseta korraldused, mis ei ole kaubeldavad. Siduv/indikatiivne – määratakse üksnes hinnapakkumistele. Indikatiivsed hinnapakkumised on nähtavad, kuid neid ei saa täita. See hõlmab mõnes kauplemiskohas ostutähti. Siduvaid hinnapakkumisi saab täita. Kaudne – kasutatakse korralduste puhul, mis on tuletatud erinevast funktsionaalsusest (implied in või implied out). Suunatud – kasutatakse korralduste puhul, mille kauplemiskoht on suunanud teistesse kauplemiskohtadesse.	„ACTI“ – aktiivne või „INAC“ – mitteaktiivne või „FIRM“ – siduvad hinnapakkumised või „INDI“ – indikatiivsed hinnapakkumised või „IMPL“ – tuletatud strateegiapõhised korraldused või „ROUT“ – suunatud korraldused. Kui asjakohased on mitu seisundit, märgitakse andmeväljale mitu tähist, mis eraldatakse komaga.

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
34	Koguseühik	Märgitakse, kas tehingu kogust väljendatakse ühikute arvu, nimiväärtuse või rahaline väärtusena.	„UNIT“ – ühikute arv „NOML“ – nimiväärtus „MONE“ – rahaline väärtus
35	Kogusevaluuta	Valuuta, milles kogus on väljendatud. Andmeväli täidetakse üksnes juhul, kui kogust väljendatakse nimiväärtuse või rahaline väärtusena.	{CURRENCYCODE_3}
36	Algne kogus	Korralduse finantsinstrumentide ühikute arv või tuletislepingute arv. Finantsinstrumendi nimiväärtus või rahaline väärtus. Hinnavahekihlvedude puhul on kogus panustatud rahaline väärtus alusvaraks oleva finantsinstrumendi punkti muutuse kohta. Tuletislepingute tingliku väärtuse suurenemise või vähenemise puhul kajastatakse muutuse absoluutväärtust ja seda väljendatakse positiivse arvuna. Krediidiriski vahetustehingute puhul on kogus tinglik summa, mille puhul on kaitse omandatud või võõrandatud.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas vajatud kogus	Kogus, mis jääb tellimusraamatusse pärast korralduse osalist täitmist või korraldust mõjutava muu sündmuse korral. Osalise täitmise korralduse puhul on see pärast osalist täitmist järelejäänud kogus kokku. Korralduse tellimusraamatusse kandmisel on see algne kogus.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.
38	Nähtav kogus	Kogus, mis on tellimusraamatus nähtav (vastandina varjatud kogusele).	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.
39	Kaubeldud kogus	Osalise või täieliku täitmise korral märgitakse sellele andmeväljale täidetud kogus.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.
40	Minimaalne aktsepteeritav kogus	Minimaalne aktsepteeritav kogus korralduse puhul, mida võidakse täita mitme osalise täitmise teel. Tavaliselt kasutatakse ainult mittepüsivate korralduste liikide puhul. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
41	Minimaalne täitmismaht	Mis tahes individuaalse võimaliku täitmise minimaalne maht. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimiväärtuses.
42	Minimaalne täitmismaht ainult esimese täitmise puhul	Märgitakse, kas minimaalne täitmismaht kehtib ainult esimese täitmise puhul. Jäetakse tühjaks, kui andmeväli 41 on jäetud tühjaks.	„õige“ „vale“
43	Üksnes passiivsuse näitaja	Näitab, kas korraldus on esitatud kauplemiskohale andmete/tähisega, mille tõttu korraldust ei saa viivitamata mis tahes nähtava vastaskorralduse vastu täita.	„õige“ „vale“
44	Passiivsus- või agressiivsusnäitaja	Osalise täitmise ja täitmise korralduse puhul näitab, kas korraldus oli juba tellimusraamatus ja pakkus likviidsust (passiivne) või käivitas korraldus tehingu ja seega kasutas likviidsust (agressiivne). Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	„PASV“ – passiivne või „AGRE“ – agressiivne.
45	Oma korralduse täitmise vältimine (*Self-Execution Prevention*)	Näitab, kas korraldus on esitatud oma korralduse täitmise vältimise kriteeriumiga, nii et seda ei täidetaks tellimusraamatu vastaspoole korraldusega, mille on sisestanud sama liige või osaline.	„õige“ „vale“
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood	Tähtnumbriline tunnuskood, millega tähistatakse kõik artikli 7 lõike 2 kohase strateegiaga seotud korraldused.	{ALPHANUM-50}
47	Suunamisstrateegia	Kohaldatav suunamisstrateegia vastavalt kauplemiskoha normidele. Kui andmeväli ei ole asjakohane, jäetakse see tühjaks.	{ALPHANUM-50}
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	Tähtnumbriline tunnuskood, mille on kauplemiskoht määranud tehingule vastavalt käesoleva määruse artiklile 12. Kauplemiskoha tehingu tunnuskood on kordumatu, ühtne ja püsiv ISO 10383 segmendi MICi ja kauplemispäeva puhul. Kui kauplemiskoht ei kasuta segmendi MICi, on kauplemiskoha tehingu tunnuskood kordumatu, ühtne ja püsiv korraldaja MICi ja kauplemispäeva puhul. Kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi komponendid ei tohi avalikustada sellise tehingu vastaspoolte andmeid, mille tunnuskood säilitatakse.	{ALPHANUM-52}

Nr	Andmeväli	Pädevale asutusele kättesaadavana säilitatavate korralduste andmete sisu	Taotluse korral pädevale asutusele korralduste andmete esitamisel kasutatavad normid ja vorming
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid	Iga sellise kauplemisetapi nimetus, mille ajal on korraldus tellimusraamatus, sealhulgas kauplemise peatamine ja kauplemispiirangud.	{ALPHANUM-50}
50	Indikatiivne oksjoni hind	Sellise finantsinstrumendi eeldatav ristumishind oksjonil, mille puhul on esitatud üks või mitu korraldust.	{DECIMAL-18/5} juhul, kui hind on väljendatud rahalises või nimiväärtuses. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus. {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena.
51	Indikatiivne oksjoni maht	Maht (finantsinstrumendi ühikute arv), mida saab täita indikatiivse oksjoni hinnaga (andmeväli 50), kui oksjon lõppes konkreetsel ajahetkel.	{DECIMAL-18/17} juhul, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna. {DECIMAL-18/5} juhul, kui kogus on väljendatud rahalises või nimiväärtuses.