

**A BIZOTTSÁG (EU) 2017/580 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE****(2016. június 24.)****a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízások lényeges adatainak megőrzésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről****(EGT-vonatkozású szöveg)**

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG,

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló, 2014. május 15-i 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre <sup>(1)</sup> és különösen annak 25. cikke (3) bekezdésének negyedik albekezdésére,

mivel:

- (1) A kereskedési helyszínek működtetőinek lehetőséget kell biztosítani annak eldöntésére, hogy milyen módon vezetik a pénzügyi eszközökkel kapcsolatos összes megbízás lényeges adataira vonatkozó nyilvántartást. A lényeges megbízási adatok hatékony és eredményes összegyűjtésének, összehasonlításának és elemzésének a piac monitoringja céljából történő lehetővé tétele érdekében azonban ezt az információt egységes szabványok és formátumok használatával kell az illetékes hatóság rendelkezésére bocsátani, amennyiben az illetékes hatóság a 600/2014/EU rendelet 25. cikke (2) bekezdésének megfelelően ilyen információt kér.
- (2) Az egyértelműség és jogbiztonság biztosítása, valamint ugyanazon adatok kettős tárolásának elkerülése érdekében ennek a rendeletnek a megbízásokhoz kapcsolódó valamennyi adatelemre ki kell terjednie, többek között azokra a részletekre, amelyeket a 26. cikk (1) és (3) bekezdésének megfelelően kell bejelenteni.
- (3) Az esetleges piaci visszaélések vagy visszaélési kísérletek hatékony észlelése és megelőzése érdekében az illetékes hatóságoknak haladéktalanul azonosítaniuk kell azokat a személyeket és szervezeteket, amelyeknek jelentős szerepük lehet a megbízási folyamatban, ideértve a kereskedési helyszínek tagjait vagy résztvevőit, a befektetési vagy végrehajtási döntésekért felelős szervezeteket, a továbbító brókereket és azokat az ügyfeleket, akiknek a nevében a megbízást kezdeményezik. Ennek megfelelően a kereskedési helyszínek működtetőinek meg kell őrizniük az említett feleket azonosító adatokat.
- (4) Ahhoz, hogy az illetékes hatóság eredményesebben tudja azonosítani egy ügyfél gyanús, esetleges visszaélésre utaló magatartását, például azt is, ha az ügyfél több befektetési vállalkozás bevonásával jár el, a kereskedési helyszínek működtetőinek nyilván kell tartaniuk azon ügyfelek személyazonosságai adatait, amelyek nevében tagjaik vagy résztvevőik benyújtották a megbízást. A működtetőknél az említett ügyfelekhez egyedi azonosítót kell rendelniük, hogy megkönnyítsék e személyek biztos és eredményes azonosítását és ezáltal lehetővé tegyék azon esetleges piaci visszaélések hatékonyabb elemzését, amelyeknek az ügyfelek részesei lehetnek.
- (5) Nem kell előírni a kereskedési helyszínek működtetői számára, hogy a kereskedési lánchoz tartozó valamennyi ügyfél azonosítóját nyilvántartásba vegyék, csak azon ügyfelek esetében van erre szükség, amelyek nevében a tag vagy résztvevő a megbízást benyújtotta.
- (6) A piaci manipuláció eredményes feltárását biztosítandó, azonosítani kell az árjegyző stratégiákat vagy hasonló tevékenységeket. Ez lehetővé teszi az illetékes hatóságok számára, hogy megkülönböztessék az olyan befektetési vállalkozástól érkező megbízásfolyamot, amely a megbízás tárgyát képező eszköz kibocsátója, vagy a megbízást átvevő kereskedési helyszín által előre meghatározott feltételek alapján jár el, azoktól a megbízásfolyamoktól, amelyek a saját nevében vagy ügyfele nevében eljáró befektetési vállalkozástól erednek.
- (7) Nyilvántartásba kell venni a megbízások adásának, módosításának, törlésének, visszautasításának és végrehajtásának pontos dátumára és időpontjára, valamint ezek részleteire vonatkozó adatokat. Ez lehetővé teszi a megbízás változásainak nyomon követését annak élettartama alatt, ami fontos lehet az esetleges piaci manipuláció és a beelőző ügyletkötési magatartás („front running behaviour”) észlelése és értékelése szempontjából.

<sup>(1)</sup> HL L 173., 2014.6.12., 84. o.

- (8) Ahhoz, hogy pontos és átfogó képet lehessen alkotni a kereskedési helyszín ajánlati könyvéről, az illetékes hatóságnak arra a kereskedési szakaszra vonatkozóan van szüksége információra, amikor a pénzügyi instrumentummal kereskednek. Ezeknek az adatoknak a felhasználásával meghatározható mindenekelőtt az, hogy az aukciós időszak vagy a folyamatos kereskedés mikor kezdődik és zárul le, és hogy a megbízások nem eredményezik-e a tőzsdei kereskedés nem tervezett szüneteltetését. Erre az információra a megbízások közötti interakció azonosításához is szükség van, különösen akkor, ha a kereskedési szakaszok az aukciókhoz hasonlóan véletlenszerű időszakban zárulnak. Az indikatív egyeztető árakra és egyeztetőáras volumenekre vonatkozó információ szintén hozzájárul az esetleges aukciós manipuláció elemzéséhez. Tekintettel arra, hogy egyetlen megbízás befolyásolhatja az egyeztető árat, az egyeztetőáras volument, vagy mindkettőt, az illetékes hatóságoknak fel kell tudniuk ismerni, hogy az egyes megbízások milyen hatást gyakorolnak ezekre az értékekre. Ezen információ hiányában nehezen lenne megállapítható, hogy melyik megbízás gyakorol hatást az említett értékekre. Emellett minden egyes releváns eseményhez sorszámot kell rendelni az események sorrendjének meghatározása céljából, amennyiben ugyanabban az időpontban két vagy több eseményre kerül sor.
- (9) A megbízások ajánlati könyvi pozíciójának pontos meghatározása lehetővé teszi az ajánlati könyv rekonstrukcióját és a megbízások végrehajtási sorrendjének elemzését, ami a piaci visszaélések felügyeletének fontos eleme. A megbízáshoz rendelt pozíció attól függ, hogy a kereskedési rendszer hogyan határozza meg a prioritást. Ezért a kereskedési helyszínek működtetőinek az ár-vizibilitás-idő prioritás vagy a nagyság-idő prioritás módszere alapján kell meghatározniuk és nyilvántartásba venniük a megbízások prioritását.
- (10) A piac hatékony monitoringjának biztosítása érdekében fontos, hogy a megbízásokat össze lehessen kapcsolni a megfelelő ügyletekkel. Ezért a kereskedési helyszínek működtetőinek egyértelmű ügyletazonosító kódokat kell alkalmazniuk a megbízások és ügyletek összekapcsolásához.
- (11) A kereskedési helyszínek működtetőinek minden egyes kapott megbízásra vonatkozóan nyilvántartásba kell venniük és meg kell őrizniük a megbízástípust és a kapcsolódó konkrét instrukciókat, mivel ezek együttesen határozzák meg azt, hogy megbízáspárosító rendszereik (matching engine) hogyan kezelik az egyes megbízásokat a saját besorolásuknak megfelelően. Az illetékes hatóságoknak szükségük van erre a részletes információra ahhoz, hogy a piaci visszaélések felügyelete keretében nyomon tudják követni egy adott kereskedési helyszín ajánlati könyvében a kereskedési tevékenységet és mindenekelőtt le tudják képezni az egyes megbízások mozgását az ajánlati könyvben. Tekintettel azonban a meglévő és a kereskedési helyszínek működtetői által kialakított potenciális új megbízástípusok széles körére és a helyszínek specifikus technikai jellemzőire, előfordulhat, hogy az említett részletes információk a működtetők belső besorolási rendszerén alapuló nyilvántartása jelenleg nem teszi lehetővé az illetékes hatóságok számára, hogy egységes módon le tudják képezni valamennyi kereskedési helyszín ajánlati könyves tevékenységét. Ezért annak biztosításához, hogy az illetékes hatóságok pontosan meg tudják határozni az egyes megbízások helyét az ajánlati könyvben, a kereskedési helyszínek működtetőinek a kapott egyes megbízásokat – amennyiben azok végrehajthatók – limitáras megbízásként, vagy – amennyiben a megbízás csak egy előre meghatározott áresemény bekövetkezése esetén hajtható végre – stop megbízásként is be kell sorolniuk.
- (12) A következetesség és a pénzügyi piacok zavartalan működése érdekében az e rendeletben megállapított rendelkezéseket és a 600/2014/EU rendelet rendelkezéseit azonos időponttól kell alkalmazni.
- (13) Ez a rendelet az Európai Értékpapírpiazi Hatóság (ESMA) által a Bizottsághoz benyújtott szabályozástechnikai standardtervezeten alapul.
- (14) Az ESMA nyilvános konzultációt folytatott az e rendelet alapját képező szabályozástechnikai standardtervezetről, elemezte az ezekkel összefüggésben felmerülő, esetleges költségeket és hasznot, és kikergette az 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet<sup>(1)</sup> 37. cikke alapján létrehozott Értékpapírpiazi Érdekképviseleti Csoport véleményét,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

#### 1. cikk

### A lényeges megbízási adatok köre, szabványai és formátuma

- (1) A kereskedési helyszínek működtetői az illetékes hatóságuk számára a melléklet 2. táblázatának második és harmadik oszlopában részletezetteknek megfelelően elérhetővé teszik a rendszerükön keresztül meghirdetett egyes megbízásokra vonatkozó, a 2–13. cikkben meghatározott adatokat, amennyiben azok az érintett megbízásra vonatkoznak.

<sup>(1)</sup> Az Európai Parlament és a Tanács 2010. november 24-i 1095/2010/EU rendelete az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapírpiazi Hatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/77/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről (HL L 331., 2010.12.15., 84. o.).

(2) Amennyiben az illetékes hatóságok a 600/2014/EU rendelet 25. cikkének (2) bekezdésével összhangban kérik az (1) bekezdésben említett adatokat, a kereskedési helyszínek működtetői azokat az e rendelet melléklete 2. táblázatának negyedik oszlopában előírt szabványok és formátumok használatával bocsátják rendelkezésre.

## 2. cikk

### A releváns felek azonosítása

(1) A kereskedési helyszínek működtetőinek valamennyi megbízás esetében meg kell őrizniük a következőkre vonatkozó adatokat:

- a) a kereskedési helyszín azon tagja vagy résztvevője, amely benyújtotta a megbízást a kereskedési helyszínnek, a melléklet 2. táblázatának 1. mezőjében meghatározottaknak megfelelően azonosítva;
- b) a megbízással összefüggő befektetési döntésért felelős személy vagy számítógépes algoritmus a kereskedési helyszín tagjánál vagy résztvevőjénél, amelyhez a megbízást benyújtották, a melléklet 2. táblázatának 4. mezőjében meghatározottaknak megfelelően azonosítva;
- c) a megbízás végrehajtásáért felelős személy vagy számítógépes algoritmus a kereskedési helyszín tagjánál vagy résztvevőjénél, a melléklet 2. táblázatának 5. mezőjében meghatározottaknak megfelelően azonosítva;
- d) a kereskedési helyszín azon tagja vagy résztvevője, amely a kereskedési helyszín másik tagja vagy résztvevője részéről és nevében továbbította a megbízást, a melléklet 2. táblázatának 6. mezőjében meghatározottaknak megfelelően továbbító brókerként azonosítva;
- e) az az ügyfél, amelynek nevében a kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője benyújtotta a megbízást a kereskedési helyszínnek, a melléklet 2. táblázatának 3. mezőjében meghatározottaknak megfelelően azonosítva;

(2) Amennyiben a kereskedési helyszín valamely tagja vagy résztvevője vagy ügyfele egy tagállam jogszabályai alapján engedéllyel rendelkezik arra, hogy egy megbízásnak a kereskedési helyszínre történő benyújtását követően allokálja a megbízást az ügyfélhez, és a megbízás benyújtásának időpontjában még nem allokálta azt az ügyfélhez, a szóban forgó megbízást a melléklet 2. táblázatának 3. mezőjében meghatározottaknak megfelelően kell azonosítani.

(3) Ha több megbízást együttesen összevont megbízásként nyújtanak be a kereskedési helyszínnek, az összevont megbízást a melléklet 2. táblázatának 3. mezőjében meghatározottaknak megfelelően kell azonosítani.

## 3. cikk

### A kereskedési helyszín tagjainak vagy résztvevőinek a kereskedésben betöltött szerepe és a likviditásnyújtási tevékenység

(1) A kereskedési helyszín tagjának vagy résztvevőjének a megbízás benyújtása során betöltött kereskedési szerepét a melléklet 2. táblázatának 7. mezőjében meghatározottaknak megfelelően kell ismertetni.

(2) A következő megbízásokat kell azonosítani a melléklet 2. táblázatának 8. mezőjében meghatározottaknak megfelelően:

- a) egy tag vagy résztvevő által a kereskedési helyszínnek árjegyzési stratégia részeként benyújtott megbízás a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv<sup>(1)</sup> 17. és 48. cikkének megfelelően;
- b) egy tag vagy résztvevő által a kereskedési helyszínnek egyéb likviditásnyújtási tevékenység részeként benyújtott megbízás, mely tevékenység a megbízás tárgyát képező eszköz kibocsátója, vagy a kereskedési helyszín által előre meghatározott feltételek alapján kerül végrehajtásra.

<sup>(1)</sup> Az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 2014/65/EU irányelve a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 349. o.).

#### 4. cikk

### Dátum és időpont nyilvántartása

(1) A kereskedési helyszín működtetői nyilvántartásba veszik az e rendelet melléklete 2. táblázatának 21. mezőjében felsorolt egyes események bekövetkezésének dátumára és időpontjára vonatkozó adatokat, az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet <sup>(1)</sup> 2. cikkében meghatározott mértékű pontossággal, az e rendelet melléklete 2. táblázatának 9. mezőjében meghatározottaknak megfelelően. A megbízás kereskedési helyszín rendszerei általi visszautasításának dátumára és időpontjára vonatkozó adatok kivételével az e rendelet melléklete 2. táblázatának 21. mezőjében említett valamennyi eseményt a kereskedési helyszín megbízáspárosító rendszere által használt üzleti órák szerinti adatokkal kell nyilvántartásba venni.

(2) A kereskedési helyszín működtetői nyilvántartásba veszik az e rendelet melléklete 2. táblázatának 49., 50. és 51. mezőjében felsorolt minden egyes adatelem dátumát és időpontját, az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelet 2. cikkében meghatározott mértékű pontossággal.

#### 5. cikk

### Érvényességi időszak és megbízási korlátozások

(1) A kereskedési helyszínek működtetői nyilvántartást vezetnek a melléklet 2. táblázatának 10. és 11. mezőjében felsorolt érvényességi időszakokról és megbízási korlátozásokról.

(2) Az érvényességi időszakokra vonatkozó dátumok és időpontok adatait az egyes időszakok esetében a melléklet 2. táblázatának 12. mezőjében meghatározottaknak megfelelően kell nyilvántartani.

#### 6. cikk

### Prioritás és sorszámok

(1) Azok a kereskedési helyszín-működtetők, amelyek a kereskedési rendszereket ár-vizibilitás-idő prioritás alapján működtetik, valamennyi megbízásra vonatkozóan nyilvántartják a prioritás időbélyegzőjét a melléklet 2. táblázatának 13. mezőjében meghatározottaknak megfelelően. A prioritás időbélyegzőjét a 4. cikk (1) bekezdésében meghatározott mértékű pontossággal kell nyilvántartani.

(2) Azok a kereskedési helyszín-működtetők, amelyek a kereskedési rendszereket nagyság-idő prioritás alapján működtetik, nyilvántartják a megbízások prioritását meghatározó mennyiségekre vonatkozó adatokat a melléklet 2. táblázatának 14. mezőjében meghatározottaknak megfelelően, valamint a prioritás (1) bekezdésben említett időbélyegzőjét.

(3) Azokra a kereskedési helyszín-működtetőkre, amelyek az ár-vizibilitás-idő prioritás és a nagyság-idő prioritás kombinációját használják és a megbízásokat az időprioritás alapján jelenítik meg ajánlati könyvükben, az (1) bekezdés előírásai alkalmazandók.

(4) Azokra a kereskedési helyszín-működtetőkre, amelyek az ár-vizibilitás-idő prioritás és a nagyság-idő prioritás kombinációját használják és a megbízásokat a nagyság-idő prioritás alapján jelenítik meg ajánlati könyvükben, a (2) bekezdés előírásai alkalmazandók.

(5) A kereskedési helyszínek működtetői valamennyi eseményhez sorszámot rendelnek és azt nyilvántartják a melléklet 2. táblázatának 15. mezőjében meghatározottaknak megfelelően.

#### 7. cikk

### A pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízások azonosító kódjai

(1) A kereskedési helyszínek működtetői a melléklet 2. táblázatának 20. mezőjében meghatározottaknak megfelelően minden egyes megbízásra vonatkozóan egyedi azonosító kódot vesznek nyilvántartásba. Az azonosító kódnak az ajánlati könyv, a kereskedési nap és a pénzügyi eszköz tekintetében egyedinek kell lennie. Ez a kód alkalmazandó a megbízásnak a kereskedési helyszín működtetője általi átvételétől kezdve a megbízás ajánlati könyvből való eltávolításáig. Az azonosító kódnak vonatkoznia kell a visszautasított megbízásokra is, függetlenül a visszautasítás indokától.

<sup>(1)</sup> A Bizottság (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. június 7.) a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek az üzleti órák összehangolásának mértékét meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 148. oldalát).

(2) A kereskedési helyszín működtetője a mellékletben meghatározottaknak megfelelően nyilvántartásba veszi azon implikált stratégiai megbízások (strategy orders with implied functionality – SOIF) releváns adatait, amelyeket a nyilvánosság számára közzétesznek. A melléklet 2. táblázata 33. mezőjének tartalmaznia kell egy arra vonatkozó nyilatkozatot, hogy a megbízás implikált megbízás.

Implikált stratégiai megbízás végrehajtásakor annak adatait a kereskedési helyszín működtetőjének a mellékletben meghatározottaknak megfelelően kell nyilvántartásba vennie.

Implikált stratégiai megbízás végrehajtásakor meg kell adni a stratégiához kapcsolt megbízás azonosító kódját, és ugyanazt az azonosító kódot kell használni egy meghatározott stratégiához kapcsolódó valamennyi megbízásra vonatkozóan. A stratégiához kapcsolt megbízások azonosító kódját a melléklet 2. táblázatának 46. mezője határozza meg.

(3) A kereskedési helyszínhez benyújtott olyan megbízásokat, amelyek esetében engedélyezett valamely továbbítási stratégia (routing strategy), az adott kereskedési helyszínnek továbbítottként kell azonosítania a melléklet 2. táblázatának 33. mezőjében meghatározottaknak megfelelően, amennyiben a megbízásokat egy másik kereskedési helyszínnek továbbították. A kereskedési helyszínhez benyújtott olyan megbízásokra vonatkozóan, amelyek esetében engedélyezett valamely továbbítási stratégia (routing strategy) azok egész élettartama alatt meg kell tartani ugyanazt az azonosító kódot, függetlenül attól, hogy bármely fennmaradó mennyiséget újra bevezetnek-e a beérkezés szerinti ajánlati könyvbe.

#### 8. cikk

### A pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízásokat befolyásoló események

A kereskedési helyszínek működtetői az új megbízásokkal kapcsolatban nyilvántartják a melléklet 2. táblázatának 21. mezőjében említett adatokat.

#### 9. cikk

### A pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízás típusa

(1) A kereskedési helyszínek működtetői a melléklet 2. táblázatának 22. mezőjében meghatározottaknak megfelelően minden egyes kapott megbízásra vonatkozóan a saját besorolásuk szerint nyilvántartják a megbízás típusát.

(2) A kereskedési helyszínek működtetői minden kapott megbízást besorolnak limitáras megbízásként vagy stop megbízásként a melléklet 2. táblázatának 23. mezőjében meghatározottaknak megfelelően.

#### 10. cikk

### A megbízásokhoz kapcsolódó árak

A kereskedési helyszínek működtetői nyilvántartják az árakhoz kapcsolódó összes, a melléklet 2. táblázatának I. szakaszában említett adatot, amennyiben azok a megbízások szempontjából relevánsak.

#### 11. cikk

### A megbízásra vonatkozó instrukciók

A kereskedési helyszínek működtetői a melléklet 2. táblázatának J. szakaszában meghatározottaknak megfelelően minden egyes kapott megbízásra vonatkozóan nyilvántartják az összes megbízási instrukciót.

#### 12. cikk

### A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja

A kereskedési helyszínek működtetői a melléklet 2. táblázatának 48. mezőjében meghatározottaknak megfelelően egy megbízás teljes vagy részleges végrehajtásából eredő valamennyi ügyletre vonatkozóan egyedi ügyletazonosító kódot tartanak nyilván.

## 13. cikk

**Kereskedési fázisok, valamint indikatív aukciós ár és volumen**

(1) A kereskedési helyszínek működtetői a melléklet 2. táblázatának K. szakaszában meghatározottaknak megfelelően nyilvántartják a megbízások részleteit.

(2) Amennyiben az illetékes hatóságok az 1. cikk szerint a K. szakaszban említett adatokat kérik, a melléklet 2. táblázatának 9., valamint 15–18. mezőjében említett adatokat szintén az adott megkeresés által érintett megbízásra vonatkozó adatnak kell tekinteni.

## 14. cikk

**Hatálybalépés és alkalmazás**

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ezt a rendeletet a 600/2014/EU rendelet 55. cikkének második bekezdésében szereplő dátumtól kell alkalmazni.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2016. június 24-én.

a Bizottság részéről  
az elnök  
Jean-Claude JUNCKER

## MELLÉKLET

## 1. táblázat

## Magyarázat a 2. táblázathoz

JELÖLÉS	ADATTÍPUS	MEGHATÁROZÁS
{ALPHANUM-n}	Legfeljebb n számú alfanumerikus karakter	Szövegmező
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerikus karakter	Az ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkódoknak megfelelő hárombetűs pénznemkód.
{DATE_TIME_FORMAT}	Az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátum	Dátum és idő a következő formátumban: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ddddddZ. — „YYYY” az év, — „MM” a hónap, — „DD” a nap, — „T” – azt jelenti, hogy a T betűt kell használni, — „hh” az óra, — „mm” a perc, — „ss.dddddd” a másodperc és annak törtrésze, — Z az UTC-idő. A dátumokat és időpontokat UTC-időben kell megadni.
{DATEFORMAT}	Az ISO 8601 szabványnak megfelelő dátumformátum	A dátumokat a következő formátumban kell megadni: YYYY-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Összesen legfeljebb n számjegyből álló tizedes tört, amely legfeljebb m számú tizedesjegyet tartalmazhat.	Numerikus mező pozitív és negatív értékek megadásához. — Tizedesjel:„.” (vessző), — a negatív számok előtt „-” (mínusz) jelet kell használni, — az értékeket kerekíteni kell, nem pedig csonkolni.
{INTEGER-n}	Összesen legfeljebb n számjegyből álló egész szám	Numerikus mező pozitív és negatív egész számértékek megjelöléséhez.
{ISIN}	12 alfanumerikus karakter	Az ISO 6166 szabványnak megfelelő ISIN-kód
{LEI}	20 alfanumerikus karakter	Az ISO 17442 szabványnak megfelelő jogalany-azonosító
{MIC}	4 alfanumerikus karakter	Az ISO 10383 szabványnak megfelelő piacazonosító
{NATIONAL_ID}	35 alfanumerikus karakter	Az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet <sup>(1)</sup> 6. cikkében és II. mellékletében meghatározott azonosító

<sup>(1)</sup> A Bizottság (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. július 28.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az ügyletek illetékes hatóságoknak történő bejelentésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 449. oldalát)

## 2. táblázat

## A megbízások részletei

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
<b>A. szakasz – A releváns felek azonosítása</b>			
1.	A megbízást benyújtó szervezet azonosítása	A kereskedési helyszín tagjának vagy résztvevőjének személyazonossága. Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA) esetén a DEA-szolgáltató által adott azonosítót kell használni.	{LEI}
2.	Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)	„igaz”, ha a megbízást DEA használatával nyújtották be a kereskedési helyszínnek a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdésének 41. pontjában meghatározottaknak megfelelően. „hamis”, ha a megbízást nem DEA használatával nyújtották be a kereskedési helyszínnek a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdésének 41. pontjában meghatározottaknak megfelelően.	„igaz” „hamis”
3.	Ügyfél-azonosító kód	A kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője ügyfelének azonosításához használt kód. DEA esetén a DEA-felhasználó kódját kell használni. Amennyiben az ügyfél jogi személy, az ügyfél LEI-kódját kell megadni. Amennyiben az ügyfél nem jogi személy, a {NATIONAL_ID} jelölést kell használni. Összevont megbízások esetén az „AGGR” jelölést kell használni az e rendelet 2. cikkének (3) bekezdésében meghatározottak szerint. Függő allokációk esetén a „PNAL” jelölést kell használni az e rendelet 2. cikkének (2) bekezdésében meghatározottak szerint. Ezt a mezőt csak akkor nem kell kitölteni, ha a kereskedési helyszín tagjának vagy résztvevőjének nincs ügyfele.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR” – összevont megbízások „PNAL” – függő allokációk
4.	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	A kereskedési helyszín tagjánál vagy résztvevőjénél a befektetési döntésért felelős személy vagy számítógépes algoritmus azonosítására használt kód az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet (22) 8. cikkének megfelelően. Amennyiben a kereskedési helyszín tagjánál vagy résztvevőjénél a befektetési döntésért természetes személy felelős, azt a személyt, aki felelős vagy elsődlegesen felelős a befektetési döntésért, a {NATIONAL_ID} jelöléssel kell azonosítani. Amennyiben a befektetési döntésért algoritmus volt felelős, ezt a mezőt az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 8. cikkében meghatározottak szerint kell kitölteni]. Ezt a mezőt akkor nem kell kitölteni, ha a befektetési döntést nem a kereskedési helyszín tagján vagy résztvevőjén belüli személy vagy számítógépes algoritmus hozta.	{NATIONAL_ID} – természetes személyek {ALPHANUM-50} – algoritmusok
5.	Végrehajtás a vállalkozáson belül	A kereskedési helyszín tagjánál vagy résztvevőjénél a megbízásból eredő ügylet végrehajtásáért felelős személy vagy számítógépes algoritmus azonosítására használt kód az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének megfelelően. Amennyiben az ügylet végrehajtásáért természetes személy felelős, azonosítására a {NATIONAL_ID} jelölést kell használni.	{NATIONAL_ID} – természetes személyek {ALPHANUM-50} – algoritmusok



Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		Amennyiben az ügylet végrehajtásáért algoritmus felelős, ezt a mezőt az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének kell kitölteni. Amennyiben az ügylet végrehajtásában egynél több személy vesz részt, illetőleg a végrehajtásra személyek és algoritmusok kombinációja révén kerül sor, a kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője vagy ügyfele határozza meg azt a kereskedőt vagy algoritmust, aki/amely elsődlegesen felelős az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének (4) bekezdésében meghatározottaknak megfelelően, és ebben a mezőben az adott kereskedő vagy algoritmus azonosítóját kell megadni.	
6.	Továbbító bróker	A 2. cikk d) pontjával összhangban. Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	{LEI}

#### B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás

7.	Kereskedési szerep	Azt jelöli, hogy a megbízási a kereskedési helyszín 2014/65/EU irányelv 4. cikkének 38. pontja szerinti saját kitétség nélküli ügyletpárosítást, vagy a 2014/65/EU irányelv 4. cikkének 6. pontja szerinti saját számlára történő kereskedést végző tagjától vagy résztvevőjétől ered-e. Amennyiben a megbízási nem a kereskedési helyszín saját kitétség nélküli ügyletpárosítást, vagy saját számlára történő kereskedést végző tagjától vagy résztvevőjétől ered, a mezőben meg kell jelölni, hogy az ügylet végrehajtására egyéb szerepben került sor.	„DEAL” – saját számlás kereskedés „MTCH” – saját kitétség nélküli ügyletpárosítás „AOTC” – egyéb szerep
8.	Likviditásnyújtási tevékenység	Azt jelöli, hogy a megbízást a 2014/65/EU irányelv 17. és 48. cikkének megfelelően árjegyzési stratégia részeként vagy e rendelet 3. cikkének megfelelően egyéb tevékenység részeként nyújtják-e be kereskedési helyszíneknek.	„igaz” „hamis”

#### C. szakasz – Dátum és idő

9.	Dátum és idő	A [G] és [K] szakaszban felsorolt minden egyes esemény dátuma és időpontja.	{DATE_TIME_FORMAT} A „másodpercek” (seconds) után álló számjegyek számát az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelet 2. cikke szerint kell meghatározni.
----	--------------	---	---

#### D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások

10.	Érvényességi időszak (Validity period)	Nap végéig (Good-For-Day): a megbízási annak a kereskedési napnak a végén válik érvénytelenné, amikor azt az ajánlati könyvbe bevezették. Visszavonásig érvényes (Good-Till-Cancelled): a megbízási a tényleges visszavonásig aktív marad az ajánlati könyvben és végrehajtható.	„DAVY” – nap végéig „GTCV” – visszavonásig érvényes
-----	--	---	--

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		<p>Adott időpontig érvényes (Good-Till-Time): a megbízás legkésőbb az adott kereskedési időszakon belül előre meghatározott időpontban jár le.</p> <p>Adott dátumig érvényes (Good-Till-Date): a megbízás meghatározott nap végén jár le.</p> <p>Meghatározott dátumig és időpontig érvényes (Good-Till-Specified Date and Time): a megbízás meghatározott napon és időpontban jár le.</p> <p>Adott időponttól érvényes (Good After Time): a megbízás az adott kereskedési időszakon belül csak egy előre meghatározott időpontot követően válik aktívvá.</p> <p>Adott dátumtól érvényes (Good After Date): a megbízás csak egy előre meghatározott dátum kezdetétől válik aktívvá.</p> <p>Meghatározott dátumtól és időponttól érvényes (Good After Specified Date and Time): a megbízás egy előre meghatározott napon csak egy előre meghatározott időponttól válik aktívvá.</p> <p>IOC megbízás (Immediate-or-Cancel – „most rész”): olyan megbízás, amely az ajánlati könyvbe való felvételekor végrehajtásra kerül (azon mennyiség tekintetében, amely végrehajtható), és amely után nem marad az ajánlati könyvben a végre nem hajtott mennyiség, amennyiben van ilyen.</p> <p>FOK megbízás (Fill-or-Kill – „most mind”): olyan megbízás, amely az ajánlati könyvbe való felvételekor azonnal végrehajtásra kerül, amennyiben teljes mértékben teljesíthető: ha a megbízás csak részben hajtható végre, akkor automatikusan visszautasításra kerül, és így nem hajtható végre.</p> <p>Egyéb: egyéb olyan egyedi megjelölés, amely egy konkrét üzleti modellre, kereskedési platformra vagy rendszerre vonatkozik.</p>	<p>„GTTV” – adott időpontig érvényes</p> <p>„GTDV” – adott dátumig érvényes</p> <p>„GTSV” – meghatározott dátumig és időpontig érvényes</p> <p>„GATV” – adott időponttól érvényes</p> <p>„GADV” – adott dátumtól érvényes</p> <p>„GASV” – meghatározott dátumtól és időponttól érvényes</p> <p>„IOCV” – most rész</p> <p>„FOKV” – most mind vagy {ALPHANUM-4} karakterek, amelyeket még nem használnak a kereskedési helyszín saját besorolásához.</p>
11.	Megbízáskorlátozás	<p>Záróár-egyeztető aukcióra elfogadható (Good For Closing Price Crossing Session): ha egy megbízás megfelel a záróár-egyeztető aukció feltételeinek.</p> <p>Aukcióra érvényes (Valid For Auction): a megbízás csak aukciós fázisokban aktív és csak akkor hajtható végre (ezeket a fázisokat (pl. nyitó és záró aukció és/vagy napon belüli aukció) előre meghatározhatja a kereskedési helyszín azon tagja vagy résztvevője, aki benyújtotta a megbízást).</p> <p>Csak folyamatos kereskedésben érvényes (Valid For Continuous Trading only): a megbízás csak folyamatos kereskedés során érvényes.</p>	<p>„SESZ” – záróár-egyeztető aukcióra elfogadható</p> <p>„VFAR” – aukcióra érvényes</p> <p>„VFCR” – csak folyamatos kereskedésben érvényes</p>

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		Egyéb: egyéb olyan egyedi megjelölés, amely egy konkrét üzleti modellre, kereskedési platformra vagy rendszerre vonatkozik.	{ALPHANUM-4} karakterek, amelyeket még nem használnak a kereskedési helyszín saját besorolásához.  Ha több típus alkalmazható, ebben a mezőben több jelölést kell megadni, vesszővel elválasztva.
12.	Érvényességi időszak és idő	Ez az adat a megbízási aktívá válásának vagy az ajánlati könyvből való végleges törlésének időpontját jelző időbélyegzőre utal  Nap végéig (Good for day): a beérkezés dátuma, közvetlenül éjfél előtti időbélyegzővel  Adott időpontig érvényes (Good till time): a beérkezés dátuma, és a megbízási megadott időpont  Adott dátumig érvényes (Good till date): a lejárat meghatározott dátuma közvetlenül éjfél előtti időbélyegzővel  Meghatározott dátumig és időpontig érvényes (Good till specified date and time): a lejárat meghatározott dátuma és időpontja  Adott időponttól érvényes (Good after time): a beérkezés dátuma és a meghatározott időpont, amikor a megbízási aktívá válik  Adott dátumtól érvényes (Good after date): a meghatározott dátum, közvetlenül éjfél utáni időbélyegzővel  Meghatározott dátumtól és időponttól érvényes (Good after specified date and time): a meghatározott dátum és időpont, amikor a megbízási aktívá válik  Visszavonásig érvényes (Good till Cancel): a végső dátum és időpont, amikor a megbízási piaci műveletek következtében automatikusan eltávolításra kerül  Egyéb: bármely további érvényességi típus időbélyegzője.	{DATE_TIME_FORMAT}  A „másodpercek” után álló számjegyek száma az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelet 2. cikkével összhangban kerül meghatározásra

**E. szakasz – Prioritás és sorszám**

13.	Prioritási időbélyegző	Ezt a mezőt minden olyan esetben frissíteni kell, amikor egy megbízási prioritása megváltozik.	{DATE_TIME_FORMAT}  A „másodpercek” után álló számjegyek száma az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelet 2. cikkével összhangban kerül meghatározásra.
14.	Nagyság prioritás	A nagyság-idő prioritás módszerét használó kereskedési helyszínek esetében ezt a mezőt a mennyiségnek megfelelő pozitív számmal kell kitölteni.  Ezt a mezőt minden olyan esetben frissíteni kell, amikor a megbízási prioritása megváltozik.	Legfeljebb 20 pozitív számjegy.
15.	Sorszám	A G. szakaszban felsorolt minden egyes eseményt növekvő számsorrendben pozitív egész szám használatával kell azonosítani.  A sorszámnak minden egyes eseménytípusra vonatkozóan egyedinek, és a kereskedési helyszín működtetője által időbélyegzővel ellátott valamennyi eseményre vonatkozóan egységessé kell lennie, és az esemény bekövetkezésének dátuma tekintetében perzisztensnek kell lennie.	{INTEGER-50}

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
------	------	---	--

#### F. szakasz – A megbízás azonosítása

16.	Szegmensazonosító MIC-kód	Azon kereskedési helyszín azonosítása, ahol a megbízást benyújtották. Amennyiben a kereskedési helyszín szegmensazonosító MIC-kódot használ, akkor ezt az azonosítót kell megadni. Amennyiben a kereskedési helyszín nem használ szegmensazonosító MIC-kódot, akkor a működtetőazonosító MIC-kódot kell megadni.	{MIC}
17.	Az ajánlati könyv kódja	A kereskedési helyszín által minden egyes ajánlati könyvre meghatározott alfanumerikus kód.	{ALPHANUM-20}
18.	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	A pénzügyi eszköz egyedi és egyértelmű azonosítója	{ISIN}
19.	Az átvétel dátuma	Az eredeti megbízás átvételének dátuma.	{DATEFORMAT}
20.	A megbízás azonosító kódja	A kereskedési helyszín működtetője által az egyedi megbízáshoz rendelt alfanumerikus kód.	{ALPHANUM-50}

#### G. szakasz – A megbízást befolyásoló események

21.	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	<p>Új megbízás: új megbízás beérkezése a kereskedési helyszín működtetőjéhez.</p> <p>Kiváltott: olyan megbízás, amely egy előre meghatározott feltétel teljesülésekor válik végrehajthatóvá vagy adott esetben végre nem hajthatóvá.</p> <p>A kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője által felváltott: ha a kereskedési helyszín tagja, résztvevője vagy ügyfele saját kezdeményezésére úgy dönt, hogy az ajánlati könyvbe előzőleg bevezetett megbízás bármely jellemzőjét megváltoztatja.</p> <p>Piaci műveletek következtében felváltott (automatikus): ha a megbízás bármely jellemzőjét a kereskedési helyszín működtetőjének számítógépes rendszere megváltoztatja. Ez magában foglalja a referencia-limitáras megbízás vagy a csúszó stoppáros (trailing stop) megbízás adott jellemzőinek megváltoztatását a megbízás ajánlati könyvbéli pozíciójának tükrözése érdekében.</p> <p>Piaci műveletek következtében felváltott (emberi beavatkozás): ha egy megbízás bármely jellemzőjét a kereskedési helyszín működtetőjének személyzete megváltoztatja. Idetartozik az a helyzet, ha a kereskedési helyszín tagjának, résztvevőjének informatikai problémák miatt szüksége van megbízásainak sürgős törlésére.</p> <p>A státus megváltoztatása a kereskedési helyszín tagjának, résztvevőjének kezdeményezésére. Ez magában foglalja az aktiválást és deaktiválást.</p>	<p>„NEWO” – új megbízás</p> <p>„TRIG” – kiváltott</p> <p>„REME” – a kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője által felváltott</p> <p>„REMA” – piaci műveletek következtében felváltott (automatikus)</p> <p>„REMh” – piaci műveletek következtében felváltott (emberi beavatkozás)</p> <p>„CHME” – a státus megváltoztatása a kereskedési helyszín tagjának/résztvevőjének kezdeményezésére</p>
-----	--	---	--

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		<p>A státus megváltozása piaci művelet következtében.</p> <p>A kereskedési helyszín tagjának, résztvevőjének kezdeményezésére törölve; ha egy tag, résztvevő vagy ügyfél a saját kezdeményezésére úgy dönt, hogy a korábban bevezetett megbízást törli.</p> <p>Piaci műveletek következtében törölve: idetartozik az árjegyzési tevékenységet végző befektetési vállalkozások számára a 2014/65/EU irányelv 17. és 48. cikkében meghatározott védelmi mechanizmus.</p> <p>Visszautasított megbízás: a kereskedési helyszín működtetője által kapott, de visszautasított megbízás.</p> <p>Lejárt megbízás: ha érvényességi időszaka végén egy megbízást törölnek az ajánlati könyvből.</p> <p>Részben teljesített: ha a megbízást nem hajtják végre teljes mértékben, és marad végrehajtandó mennyiség.</p> <p>Teljesített: ha már nincs végrehajtandó mennyiség.</p>	<p>„CHMO” – a státus megváltozása piaci művelet következtében</p> <p>„CAME” – a kereskedési helyszín tagjának vagy résztvevőjének kezdeményezésére törölve</p> <p>„CAMO” – piaci műveletek következtében törölve</p> <p>„REMO” – visszautasított megbízás</p> <p>„EXPI” – lejárt megbízás</p> <p>„PARF” – részben teljesített</p> <p>„FILL” – teljesített</p> <p>{ALPHANUM-4} karakterek, amelyeket még nem használnak a kereskedési helyszín saját besorolásához.</p>

#### H. szakasz – Megbízás típusa

22.	A megbízás típusa	Azonosítja a kereskedési helyszínnek benyújtott megbízás típusát a helyszín specifikációja szerint.	{ALPHANUM-50}
23.	A megbízástípus besorolása	<p>A megbízás besorolása a két általános megbízástípus alapján. Limitáras megbízás (LIMIT): ha a megbízás végrehajtható, valamint</p> <p>Stop megbízás (Stop): ha a megbízás csak egy előre meghatározott áresemény bekövetkezésekor aktiválódik.</p>	A limitáras megbízáshoz az „LMTO”, a stop megbízáshoz az „Stop” megjelölést kell használni.

#### I. szakasz – Árak

24.	Limitár	<p>Az a maximális ár, amelyen egy vételi megbízás végrehajtható, vagy az a minimális ár, amelyen egy eladási megbízás végrehajtható.</p> <p>Egy stratégiai megbízás különbözeti árfolyama. Lehet negatív vagy pozitív.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ha az ár megadása monetáris értékkel történik.</p> <p>Ha az ár megadása monetáris értékkel történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.</p>
-----	---------	--	---

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		<p>Olyan megbízások esetében, amelyeknek nincs limitáruk, vagy nem árazott megbízások esetében ezt a mezőt üresen kell hagyni.</p> <p>Átváltható kötvény esetén ebben a mezőben a megbízáshoz használt tényleges (tisza vagy piszkos) árat kell megadni.</p>	<p>{DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.</p> <p>{DECIMAL-18/17} ha az ár megadása bázispontban történik.</p>
25.	Kiegészítő limitár	Bármely más limitár, amely alkalmazható a megbízásra. Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	<p>{DECIMAL-18/13} ha az ár megadása monetáris értékkel történik.</p> <p>Ha az ár megadása monetáris értékkel történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.</p> <p>{DECIMAL-18/17} ha az ár megadása bázispontban történik.</p>
26.	Stop ár	<p>Az az ár, amelyet el kell érni ahhoz, hogy a megbízás aktívvá váljon.</p> <p>A pénzügyi eszköz árától független események által kiváltott stop megbízás esetén ebben a mezőben a stop árra nullát kell megadni.</p> <p>Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ha az ár megadása monetáris értékkel történik.</p> <p>Ha az ár megadása monetáris értékkel történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.</p> <p>{DECIMAL-18/17} ha az ár megadása bázispontban történik.</p>
27.	Referencia-limitár	<p>Az a maximális ár, amelyen egy referencia-limitáras vételi megbízás végrehajtható, vagy az a minimális ár, amelyen egy referencia-limitáras eladási megbízás végrehajtható.</p> <p>Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ha az ár megadása monetáris értékkel történik.</p> <p>Ha az ár megadása monetáris értékkel történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.</p> <p>{DECIMAL-18/17} ha az ár megadása bázispontban történik.</p>

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
28.	Ügyleti ár	<p>Az ügylet kereskedett ára, adott esetben a jutalék és a felhalmozott kamat nélkül.</p> <p>Opció ügyletek esetében ez a származtatott ügylet díja alaptermékenként vagy indexpontként.</p> <p>Különböztet fogadás (spread bet) esetén ez a közvetlen alaptermék referenciaára.</p> <p>Hitel-nemteljesítési csereügylet (CDS) esetén ez a kupon bázispontokban kifejezve.</p> <p>Ha az ár megadása monetáris értéken történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.</p> <p>Amennyiben nem alkalmazható ár, a mezőben a „NOAP” jelölést kell megadni.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ha az ár megadása monetáris értékkel történik.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.</p> <p>{DECIMAL-18/17} ha az ár megadása bázispontban történik.</p> <p>„NOAP”</p>
29.	Az ár pénzneme	Az a pénznem, amelyben a megbízás tárgyát képező pénzügyi eszközre vonatkozó kereskedési árat kifejezik (akkor alkalmazandó, ha az árat monetáris értékkel adják meg).	{CURRENCYCODE_3}
30.	Az ügylet 2. oldalának pénzneme	<p>Többdevizás vagy keresztdevizás csereügyletek esetében az ügylet 2. oldalának pénzneme az a pénznem, amelyben az ügylet 2. oldala denominált.</p> <p>Olyan csereügyletre szóló opciók esetében, ahol a mögöttes swapügylet többdevizás, az ügylet 2. oldalának pénzneme az a pénznem, amelyben a csereügylet 2. oldala denominált.</p> <p>Ezt a mezőt csak származtatott kamatláb- és devizaügyletekre kell kitölteni.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31.	Ármegjelölés	Azt jelöli, hogy az árat monetáris értékkel, százalékos arányként, hozammal vagy bázisponttal fejezik-e ki.	<p>„MONE” – monetáris érték</p> <p>„PERC” – százalék</p> <p>„YIEL” – hozam</p> <p>„BAPO” – bázispont</p>

#### J. szakasz – A megbízáásra vonatkozó instrukciók

32.	Vétel/eladás mutató	<p>Azt jelzi, hogy vételi vagy eladási megbízásról van-e szó.</p> <p>Opciók és csereügyletre szóló opciók (swaption) esetében a vevő az a fél, aki jogosult az opció gyakorlására, az eladó pedig az a fél, aki eladja az opciót és megkapja a díjat.</p> <p>A devizához kapcsolódó határidős tőzsdei ügyletektől (future) és tőzsdén kívüli határidős ügyletektől (forward) eltérő határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek esetében a vevő az a fél, aki megveszi az instrumentumot, az eladó pedig az a fél, aki eladja azt.</p> <p>Az értékpapírokhoz kapcsolódó swapügyletek esetében a vevő az a fél, aki átveszi az alapul szolgáló értékpapír árfolyammozgásának kockázatát és megkapja a biztosítékösszeget. Az eladó az a fél, aki fizeti a biztosítékösszeget.</p>	<p>„BUY” – vétel</p> <p>„SELL” – eladás</p>
-----	---------------------	--	---

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
		<p>Kamatlábbhoz vagy inflációs indexhez kapcsolódó swapügylet esetén a vevő az a fél, aki a rögzített kamatot fizeti. Az eladó az a fél, aki a rögzített kamatot kapja. Báziswapok (változó kamatláb cseréje változó kamatlábra) esetében a vevő az a fél, aki fizeti a különbözetet, az eladó pedig az a fél, aki azt megkapja.</p> <p>Devizawapok és tőzsdén kívüli határidős devizaügyletek, valamint keresztdevizás swapügyletek esetében a vevő az a fél, aki megkapja az ISO 4217 szabvány szerinti betűrendben első devizát, az eladó pedig az a fél, aki szállítja ezt a devizát.</p> <p>Az osztalékokhoz kapcsolódó swapügyletek esetében a vevő az a fél, aki megkapja a tényleges osztalékfizetésnek megfelelő ellenértéket. Az eladó az a fél, aki fizeti az osztalékot és megkapja a rögzített kamatot.</p> <p>A hitelkockázat átadásához kapcsolódó származtatott instrumentumok esetében (kivéve az opciókat és a csereügyletre szóló opciókat) a vevő az a fél, aki a védelmet megvásárolja. Az eladó az a fél, aki eladja a védelmet.</p> <p>Az áruhoz vagy kibocsátási egységhez kapcsolódó származtatott ügyletek esetében a vevő az a fél, aki a megadott árut vagy kibocsátási egységet megkapja, az eladó pedig az a fél, aki szállítja ezt az árut vagy kibocsátási egységet.</p> <p>Tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások esetében a vevő az a fél, aki a rögzített kamatot fizeti, az eladó pedig az a fél, aki megkapja azt.</p> <p>A névérték növekedése esetében a vevő megegyezik az eredeti ügyletben a pénzügyi eszközt megvásárlóval, az eladó pedig megegyezik az eredeti ügyletben a pénzügyi eszközt elidegenítővel.</p> <p>A névérték csökkenése esetében a vevő megegyezik az eredeti ügyletben a pénzügyi eszközt rendelkezésre bocsátóval, az eladó pedig megegyezik az eredeti ügyletben a pénzügyi eszközt megvásárlóval.</p>	
33.	A megbízási státusza	<p>Itt kell megjelölni, hogy egy megbízási aktív/inaktív/felfüggesztett/kötelező érvényű/indikatív (csak jegyzésekhez)/implikált/újrátovábbított.</p> <p>Aktív – nem jegyzett, végrehajtható megbízások.</p> <p>Inaktív – nem jegyzett, végre nem hajtható megbízások.</p> <p>Kötelező érvényű/indikatív – csak jegyzésekhez rendelhető hozzá. Az indikatív jegyzés azt jelenti, hogy látható, de nem hajtható végre. Ez egyes kereskedési helyszíneken magában foglalja az opciós utalványokat. A kötelező érvényű jegyzések végrehajthatók.</p> <p>Implikált – olyan stratégiai megbízásokra vonatkozik, amelyek beimplikáló vagy kiimplikáló funkcionalitásból eredeztethetők.</p> <p>Továbbított – olyan megbízásokra vonatkozik, amelyeket a kereskedési helyszín továbbít más helyszínekre.</p>	<p>„ACTI” – aktív vagy „INAC” – inaktív vagy „FIRM” – kötelező érvényű jegyzés vagy „INDI” – indikatív jegyzés vagy „IMPL” – implikált stratégiai megbízási vagy „ROUT” – továbbított megbízási.</p> <p>Ha több státusz alkalmazható, ebben a mezőben több jelölést kell megadni, vesszővel elválasztva.</p>



Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
34.	A mennyiség megjelölése	Azt jelöli, hogy a mennyiséget az egységek számával, névértékkel vagy monetáris értékkel fejezik-e ki.	„UNIT” – egységek száma „NOML” – névérték „MONE” – monetáris érték
35.	A mennyiség pénzneme	Az a pénznem, amelyben a mennyiség kifejezésre kerül. Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha a mennyiséget névértékkel vagy monetáris értékkel fejezik ki.	{CURRENCYCODE_3}
36.	Kezdeti mennyiség	A pénzügyi eszköz egységeinek száma, vagy a származtatott ügyletek száma a megbízásban. A pénzügyi eszköz névértéke vagy monetáris értéke. Különbözetre fogadás (spread bet) esetén a mennyiség a kockáztatott monetáris érték az alapul szolgáló pénzügyi eszköz egységnyi áralakulásakor. A növekvő vagy csökkenő névértékű származtatott ügyletek esetében a szám a változás abszolút értékét tükrözi és pozitív számmal kell kifejezni. Hitel-nemteljesítési csereügyletek esetében a mennyiség az a névleges összeg, amelyre vonatkozóan a védelmet megszerzik vagy rendelkezésre bocsátják.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.
37.	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	Az a teljes mennyiség, amely a részleges végrehajtást követően vagy bármely más, a megbízást befolyásoló esemény bekövetkezésekor az ajánlati könyvben marad. A megbízás részleges teljesítése esetén ez a részleges végrehajtást követően a teljes fennmaradó volumen. A megbízás ajánlati könyvbe való bevezetésekor ennek meg kell egyeznie a kezdeti mennyiséggel.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.
38.	Megjelenített mennyiség	Az a mennyiség, amely az ajánlati könyvben látható (ellentétben a nem látható mennyiséggel).	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.
39.	Kereskedett mennyiség	Részleges vagy teljes végrehajtás esetében ebben a mezőben a végrehajtott mennyiséget kell megadni.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.
40.	Minimális elfogadható mennyiség (Minimum Acceptable Quantity – MAQ)	Egy teljesítendő megbízás esetében a legkisebb elfogadható mennyiség, ami több részleges végrehajtásból állhat, és általában csak nem perzisztens megbízástípusokra vonatkozik. Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
41.	Minimális végrehajtható nagyság (MES)	Valamely egyedi potenciális végrehajtás minimális végrehajtási nagysága. Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik. {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.
42.	Csak az első végrehajtásra vonatkozó minimális végrehajtható nagyság	Meghatározza, hogy a minimális végrehajtható nagyság csak az első végrehajtásra vonatkozik-e. Amennyiben a 41. mező nincs kitöltve, ezt a mezőt üresen lehet hagyni.	„igaz” „hamis”
43.	Passzív megbízási mutatója	Azt jelöli, hogy a megbízást olyan jelzéssel nyújtották-e be a kereskedési helyszínnek, amely meghatározza, hogy a megbízást nem kell látható megbízásokkal szemben azonnal végrehajtani.	„igaz” „hamis”
44.	Passzív vagy agresszív megbízási mutatója	Egy megbízási részleges teljesítése vagy teljesítése esetén annak megjelölése, hogy a megbízási már benne volt-e az ajánlati könyvben és likviditást biztosít (passzív), vagy a megbízási kereskedést kezdeményezett és így likviditást használt fel (agresszív). Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	„PASV” – passzív vagy „AGRE” – agresszív.
45.	Önvégrehajtás megakadályozása	Azt jelöli, hogy a megbízási bevezetésére az önvégrehajtás megakadályozására vonatkozó kritériummal került-e sor, ami azt jelenti, hogy a megbízási nem hajtható végre ugyanazon tag vagy résztvevő által az ajánlati könyv ellentétes oldalára bevezetett megbízásival szemben.	„igaz” „hamis”
46.	Stratégiához kapcsolt megbízási azonosítása	A 7. cikk (2) bekezdésének megfelelően egy stratégia részét képező valamennyi összekapcsolódó megbízási összekapcsolásához használt alfanumerikus kód.	{ALPHANUM-50}
47.	Továbbítási stratégia	Az alkalmazandó továbbítási stratégia a kereskedési helyszín specifikációja szerint. Ha nem releváns, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	{ALPHANUM-50}
48.	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	A kereskedési helyszín által az ügyletbe rendelt alfanumerikus kód az e rendelet 12. cikkének megfelelően. A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódjának az egyes, ISO 10383 szabvány szerinti szegmensazonosító MIC-kódok és az egyes kereskedési napok tekintetében egyedinek, egységessnek és perzisztensnek kell lennie. Amennyiben egy kereskedési helyszín nem használ szegmensazonosító MIC-kódot, a kereskedési helyszín ügyletazonosító kódjának egyedinek, egyértelműnek és perzisztensnek kell lennie az egyes működtetőazonosító MIC-kódok és kereskedési napok tekintetében. Az ügyletazonosító kód összetevői nem fedhetik fel azon ügylet feleinek személyazonosságát, amelyre a kódot alkalmazzák.	{ALPHANUM-52}

Szám	Mező	Az illetékes hatóság számára megőrzendő megbízási adatok tartalma	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
------	------	---	--

**K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen**

49.	Kereskedési fázisok	Az egyes különböző kereskedési fázisok neve, amelyek során egy megbízási jelen van az ajánlati könyvben, ideértve a tőzsdei termék kereskedésének szüneteltetését, a tőzsdei működés szüneteltetését és a felfüggesztéseket.	{ALPHANUM-50}
50.	Indikatív aukciós ár	Az az ár, amely az egy vagy több megbízási tárgyat képező pénzügyi eszközre vonatkozó egyes aukciók keretében lezajlott egyeztetés eredménye.	{DECIMAL-18/5} ha az ár megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik.  Ha az ár megadása monetáris értéken történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.  {DECIMAL-11/10} ha az ár megadása százalékkal vagy hozammal történik.
51.	Indikatív aukciós volumen	Az a volumen (a pénzügyi eszköz egységeinek száma), amely az 50. mezőben megadott indikatív aukciós áron végrehajtható, amennyiben az aukció pontosan a megadott időpontban lezárulna.	{DECIMAL-18/17} ha a mennyiség megadása az egységek számával történik.  {DECIMAL-18/5} ha a mennyiség megadása monetáris értékkel vagy névértékkel történik