

**GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2017/580 VAN DE COMMISSIE****van 24 juni 2016****tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ten aanzien van technische reguleringsnormen voor het bijhouden van relevante gegevens met betrekking tot orders in financiële instrumenten****(Voor de EER relevante tekst)**

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, en met name artikel 25, lid 3, vierde alinea,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Exploitanten van handelsplatformen moeten vrij de manier kunnen bepalen waarop zij een register bijhouden van relevante gegevens met betrekking tot alle orders in financiële instrumenten. Echter, om efficiënte en effectieve collatie, vergelijking en analyse van de relevante ordergegevens ten behoeve van markttoezicht mogelijk te maken, moet dergelijke informatie onder gebruikmaking van uniforme normen en formaten aan de bevoegde autoriteiten ter beschikking worden gesteld indien een bevoegde autoriteit om dergelijke informatie verzoekt ingevolge artikel 25, lid 2, van Verordening (EU) nr. 600/2014.
- (2) Om voor duidelijkheid en rechtszekerheid te zorgen en dubbele opslag van dezelfde informatie te vermijden, moet deze verordening gelden voor alle gegevenselementen in verband met orders, met inbegrip van nadere gegevens die moeten worden gerapporteerd overeenkomstig artikel 26, leden 1 en 3.
- (3) Om potentieel marktmisbruik of poging tot marktmisbruik effectief op te sporen en te onderzoeken, moeten de bevoegde autoriteiten onmiddellijk personen en entiteiten identificeren die op significante wijze betrokken kunnen zijn bij het orderproces, met inbegrip van leden van of deelnemers aan handelsplatformen, entiteiten die verantwoordelijk zijn voor beleggings- en uitvoeringsbesluiten, niet-uitvoerende makelaars en cliënten namens wie orders worden geïnitieerd. Dienovereenkomstig moeten exploitanten van handelsplatformen de identificatoren van dergelijke partijen bijhouden.
- (4) Om de bevoegde autoriteiten in staat te stellen op efficiëntere wijze verdachte patronen van potentieel frauduleus gedrag van een cliënt te identificeren, inclusief indien de cliënt opereert via een aantal beleggingsondernemingen, moeten de exploitanten van handelsplatformen de identiteit van cliënten registreren namens wie hun leden of deelnemers de order hebben ingelegd. Exploitanten moeten die cliënten identificeren aan de hand van unieke identificatoren om zekere en efficiënte identificatie van dergelijke personen te vergemakkelijken en daardoor een effectievere analyse mogelijk te maken van potentieel marktmisbruik waarbij cliënten betrokken kunnen zijn.
- (5) Exploitanten van handelsplatformen dienen niet verplicht te worden cliëntenidentificatoren voor alle cliënten in de handelsketen te registreren, maar slechts voor de cliënt namens wie het lid of de deelnemer de order heeft ingelegd.
- (6) De identificatie van marketmakingstrategieën of soortgelijke activiteiten is belangrijk om efficiënte opsporing van marktmanipulatie mogelijk te maken. Dit biedt de bevoegde autoriteiten de mogelijkheid om de orderstroom afkomstig van een beleggingsonderneming die handelt op basis van voorwaarden die vooraf zijn bepaald door de emittent van het instrument dat het voorwerp is van de order of door het handelsplatform waarbij de order wordt ingelegd te onderscheiden van de orderstroom die afkomstig is van een beleggingsonderneming die naar eigen goeddunken of naar goeddunken van de cliënt handelt.
- (7) Er moet een register worden bijgehouden van de exacte datum en het exacte tijdstip en van nadere gegevens met betrekking tot plaatsing, wijziging, annulering, verwerping en uitvoering van orders. Dit maakt het mogelijk wijzigingen van een order tijdens de levensduur ervan te monitoren, hetgeen significant kan zijn bij het opsporen en beoordelen van potentiële marktmanipulatie en frontrunninggedragingen.

<sup>(1)</sup> PBL 173 van 12.6.2014, blz. 84.

- (8) Om voor een accuraat en volledig beeld van het orderboek van een handelsplatform te zorgen, vereisen de bevoegde autoriteiten informatie over handelssessies waarin financiële instrumenten worden verhandeld. Deze informatie kan met name worden gebruikt om te bepalen wanneer veiligingsperiodes of de doorlopende handel beginnen en eindigen en of orders ongeplande circuit breakers veroorzaken. Deze informatie is eveneens vereist om te identificeren hoe orders zullen interageren, vooral wanneer sessies eindigen op willekeurige tijdstippen zoals veilingen. Met behulp van informatie over de indicatieve prijzen en volumes van de uncrossing zou eveneens mogelijke veilingmanipulatie kunnen worden geanalyseerd. Aangezien één enkele order een invloed kan hebben op de prijs van de uncrossing van de veiling, het volume van de uncrossing van de veiling of beide, moeten de bevoegde autoriteiten de impact van elke order op deze waarden kunnen zien. Zonder deze informatie zou het moeilijk zijn om te identificeren welke order van invloed is geweest op die waarden. Bovendien moet een volgnummer worden toegekend aan elke relevante gebeurtenis om de volgorde van gebeurtenissen te bepalen wanneer twee of meer gebeurtenissen tegelijkertijd plaatsvinden.
- (9) Specificatie van de positie van de orders in een orderboek maakt de reconstructie van het orderboek en analyse van de volgorde van uitvoering van orders mogelijk, hetgeen een belangrijk element is van het toezicht op marktmisbruik. De aan een order toegekende positie hangt af van de wijze waarop door het handelssysteem prioriteit wordt bepaald. Derhalve moeten exploitanten van handelsplatformen informatie toekennen en bijhouden inzake de prioriteit van orders volgens de prijszichtbaarheids-tijdsprioriteit- of de omvangs-tijdsprioriteitsmethode.
- (10) Om effectieve marktmonitoring mogelijk te maken, moeten orders aan hun overeenkomstige transacties kunnen worden gekoppeld. Dienovereenkomstig moeten exploitanten van handelsplatformen aparte transactie-identificatiecodes bijhouden aan de hand waarvan orders aan transacties worden gekoppeld.
- (11) Exploitanten van handelsplatformen dienen, overeenkomstig hun eigen classificatie, voor elke ontvangen order het type order en de gerelateerde specifieke instructies te registreren en bij te houden die samen bepalen hoe elke order door hun matchingmachines moet worden behandeld. Deze gedetailleerde informatie is essentieel willen de bevoegde autoriteiten, in het kader van hun toezicht op marktmisbruik, een handelsactiviteit in een bepaald orderboek van een handelsplatform kunnen monitoren en met name het gedrag van elk order binnen het orderboek kunnen reproduceren. Echter, gezien het brede scala aan bestaande en potentiële nieuwe types orders die door exploitanten van handelsplatformen worden ontwikkeld en de specifieke technische kenmerken ervan, staat het bijhouden van deze gedetailleerde informatie volgens het interne classificatiesysteem van de exploitanten de bevoegde autoriteiten momenteel mogelijk niet toe de orderboekactiviteit van alle handelsplatformen op consistente wijze te reproduceren. Opdat de bevoegde autoriteiten elke order binnen het orderboek precies kunnen lokaliseren, moeten exploitanten van handelsplatformen derhalve elke ontvangen order ook classificeren ofwel als een limietorder indien de order uitvoerbaar is, of als een stoporder indien de order uitvoerbaar wordt wanneer een vooraf bepaalde prijsgebeurtenis intreedt.
- (12) Ter wille van de consistentie en om de soepele werking van de financiële markten te verzekeren, moeten de in deze verordening neergelegde bepalingen en de in Verordening (EU) nr. 600/2014 neergelegde bepalingen vanaf dezelfde datum van toepassing zijn.
- (13) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die de Europese Autoriteit voor effecten en markten (ESMA) bij de Commissie heeft ingediend.
- (14) De ESMA heeft openbare publieksraadplegingen gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd en de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad <sup>(1)</sup> opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

#### Artikel 1

#### Toepassingsgebied, normen en formaat van relevante ordergegevens

1. Exploitanten van handelsplatformen houden de in de artikelen 2 tot en met 13 beschreven nadere gegevens zoals gespecificeerd in de tweede en derde kolom van tabel 2 van de bijlage, voor zover deze op de betrokken order betrekking hebben, van elke via hun systemen verhandelde order ter beschikking van hun bevoegde autoriteit.

<sup>(1)</sup> Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

2. Indien bevoegde autoriteiten overeenkomstig artikel 25, lid 2, van Verordening (EU) nr. 600/2014 om nadere gegevens verzoeken als bedoeld in lid 1, verstrekken exploitanten van handelsplatformen deze nadere gegevens met gebruikmaking van de normen en formaten die zijn voorgeschreven in de vierde kolom van tabel 2 van de bijlage bij deze verordening.

#### Artikel 2

##### Identificatie van de relevante partijen

1. Voor alle orders houden exploitanten van handelsplatformen een register bij van het volgende:
  - a) het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die de order bij het handelsplatform heeft ingelegd, geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 1 van tabel 2 van de bijlage;
  - b) de persoon of het computeralgoritme binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform waarbij een order is ingelegd die/dat verantwoordelijk is voor het beleggingsbesluit ten aanzien van de order, geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 4 van tabel 2 van de bijlage;
  - c) de persoon of het computeralgoritme binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die/dat verantwoordelijk is voor de uitvoering van de order, geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 5 van tabel 2 van de bijlage;
  - d) het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die de order namens en in naam van een ander lid van of een andere deelnemer aan het handelsplatform heeft gerouteerd, geïdentificeerd als een niet-uitvoerende makelaar zoals gespecificeerd in veld 6 van tabel 2 van de bijlage;
  - e) de cliënt namens wie het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform de order bij het handelsplatform heeft ingelegd, geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 3 van tabel 2 van de bijlage.
2. Indien een lid van of deelnemer aan of cliënt van het handelsplatform krachtens de wetgeving van een lidstaat na inlegging van een order bij het handelsplatform de order aan zijn cliënt mag toewijzen en bij de inlegging van de order de order nog niet aan zijn cliënt heeft toegewezen, wordt die order geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 3 van tabel 2 van de bijlage.
3. Indien verschillende orders samen als een geaggregeerde order bij het handelsplatform worden ingelegd, wordt de geaggregeerde order geïdentificeerd als gespecificeerd in veld 3 van tabel 2 van de bijlage.

#### Artikel 3

##### De handelshoedanigheid van leden van of deelnemers aan het handelsplatform en de activiteit van liquiditeitsverschaffing

1. De handelshoedanigheid waarin het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform een order inlegt, wordt beschreven als gespecificeerd in veld 7 van tabel 2 van de bijlage.
2. De volgende orders worden geïdentificeerd zoals gespecificeerd in veld 8 van tabel 2 van de bijlage:
  - a) een order die door een lid of deelnemer bij een handelsplatform is ingelegd in het kader van een marketmakingsstrategie ingevolge de artikelen 17 en 48 van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad <sup>(1)</sup>;
  - b) een order die door een lid of deelnemer bij een handelsplatform is ingelegd in het kader van een andere liquiditeitsverschaffingsactiviteit die wordt uitgevoerd op basis van voorwaarden die vooraf door de emittent van het instrument dat het voorwerp is van de order of door dat handelsplatform zijn bepaald.

<sup>(1)</sup> Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten voor financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU (PBL 173 van 12.6.2014, blz. 349).

*Artikel 4***Datum- en tijdstipregistratie**

1. Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van de datum en het tijdstip waarop een gebeurtenis zich voordoet die is opgenomen in veld 21 van tabel 2 van de bijlage bij deze verordening met de nauwkeurigheid gespecificeerd bij artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574 van de Commissie <sup>(1)</sup> zoals gespecificeerd in veld 9 van tabel 2 van de bijlage bij deze verordening. Met uitzondering van de registratie van de datum en het tijdstip van de verwerping van orders door handelsplatformsystemen worden alle gebeurtenissen waarvan sprake in veld 21 van tabel 2 van de bijlage bij deze verordening geregistreerd met gebruikmaking van de beursklokken die door de matching-machines van de handelsplatformen worden gebruikt.
2. Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van de datum en het tijdstip voor elk gegevenselement dat is opgenomen in de velden 49, 50 en 51 van tabel 2 van de bijlage bij deze verordening met de nauwkeurigheid gespecificeerd bij artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574.

*Artikel 5***Geldigheidsperiode en orderbeperkingen**

1. Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van de geldigheidsperiodes en orderbeperkingen waarvan sprake in de velden 10 en 11 van tabel 2 van de bijlage.
2. Er wordt een register bijgehouden van de datums en tijdstippen met betrekking tot geldigheidsperiodes zoals gespecificeerd in veld 12 van tabel 2 van de bijlage voor elke geldigheidsperiode.

*Artikel 6***Prioriteits- en volgordenummers**

1. Exploitanten van handelsplatformen die handelssystemen exploiteren op basis van een prijszichtbaarheids-tijdsprioriteit houden een register bij van het prioriteitstijdstempel voor alle orders zoals gespecificeerd in veld 13 van tabel 2 van de bijlage. Het tijdstempel wordt met dezelfde nauwkeurigheid bijgehouden als gespecificeerd in artikel 4, lid 1.
2. Exploitanten van handelsplatformen die handelssystemen exploiteren op basis van een omvangs-tijdsprioriteit houden een register bij van de hoeveelheden die de prioriteit van orders bepalen zoals gespecificeerd in veld 14 van tabel 2 van de bijlage alsook het prioriteitstijdstempel waarvan sprake in lid 2.
3. Exploitanten van handelsplatformen die een combinatie van prijszichtbaarheids-tijdsprioriteit en omvangs-tijdsprioriteit gebruiken en orders in hun orderboek weergeven op basis van tijdsprioriteit voldoen aan lid 1.
4. Exploitanten van handelsplatformen die een combinatie van prijszichtbaarheids-tijdsprioriteit en omvangs-tijdsprioriteit gebruiken en orders in hun orderboek weergeven op basis van omvangs-tijdsprioriteit voldoen aan lid 2.
5. Exploitanten van handelsplatformen belasten zich met het toekennen en bijhouden van een volgnummer voor alle gebeurtenissen zoals gespecificeerd in veld 15 van tabel 2 van de bijlage.

*Artikel 7***Identificatiecodes voor orders in financiële instrumenten**

1. Exploitanten van handelsplatformen houden een individuele identificatiecode bij voor elk order als gespecificeerd in veld 20 van tabel 2 van de bijlage. De identificatiecode is uniek per orderboek, per handelsdag en per financieel instrument. Zij is van toepassing vanaf de ontvangst van de order door de exploitant van het handelsplatform tot aan de verwijdering van de order uit het orderboek. De identificatiecode geldt ook voor verworpen orders ongeacht de reden voor de verwerping.

<sup>(1)</sup> Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574 van de Commissie van 7 juni 2016 tot aanvulling van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor het accuratesseniveau van beursklokken (zie bladzijde 148 van dit Publicatieblad).

2. De exploitant van het handelsplatform houdt de relevante nadere gegevens bij over strategie-orders met impliciete functionaliteit (strategy orders with implied functionality — SOIF) die openbaar worden gemaakt zoals gespecificeerd in de bijlage. Veld 33 van tabel 2 van de bijlage bevat een verklaring dat de order een impliciete order is.

Na uitvoering van een SOIF worden de betrokken nadere gegevens bijgehouden door de exploitant van het handelsplatform als gespecificeerd in de bijlage.

Na uitvoering van een SOIF wordt een strategiegebonden orderidentificatiecode vermeld onder gebruikmaking van dezelfde identificatiecode voor alle orders die verband houden met een bepaalde strategie. De strategiegebonden orderidentificatiecode dient te voldoen aan de specificatie in veld 46 van tabel 2 van de bijlage.

3. Bij een handelsplatform ingelegde orders die een routeringsstrategie mogelijk maken, worden door dat handelsplatform geïdentificeerd als „gerouteerd” zoals gespecificeerd in veld 33 van tabel 2 van de bijlage wanneer zij naar een ander handelsplatform worden gerouteerd. Bij een handelsplatform ingelegde orders die een routeringsstrategie mogelijk maken, behouden tijdens hun hele levensduur dezelfde identificatiecode, ongeacht of een resterende hoeveelheid terugkeert naar het orderboek van invoering.

#### *Artikel 8*

### **Gebeurtenissen die van invloed zijn op orders in financiële instrumenten**

Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van de nadere gegevens waarvan sprake in veld 21 van tabel 2 van de bijlage in verband met de nieuwe orders.

#### *Artikel 9*

### **Type order in financiële instrumenten**

1. Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van het ordertype voor elke ontvangen order met gebruikmaking van hun eigen classificatie als gespecificeerd in veld 22 van tabel 2 van de bijlage.

2. Exploitanten van handelsplatformen classificeren elke ontvangen order als een limietorder of een stoporder zoals gespecificeerd in veld 23 van tabel 2 van de bijlage.

#### *Artikel 10*

### **Prijzen in verband met orders**

Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van alle prijsgerelateerde nadere gegevens waarvan sprake in deel I van tabel 2 van de bijlage voor zover deze betrekking hebben op de orders.

#### *Artikel 11*

### **Orderinstructies**

Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van alle voor elke order ontvangen orderinstructies als gespecificeerd in deel J van tabel 2 van de bijlage.

#### *Artikel 12*

### **Transactie-identificatiecode van het handelsplatform**

Exploitanten van handelsplatformen houden een individuele transactie-identificatiecode bij voor elke transactie die voortvloeit uit de gehele of gedeeltelijke uitvoering van een order als gespecificeerd in veld 48 van tabel 2 van de bijlage.

*Artikel 13***Handelsfasen en indicatieve veilingprijs en indicatief veilingvolume**

1. Exploitanten van handelsplatformen houden een register bij van de nadere gegevens met betrekking tot orders als gespecificeerd in deel K van tabel 2 van de bijlage.
2. Indien bevoegde autoriteiten ingevolge artikel 1 om nadere gegevens verzoeken waarvan sprake in deel K worden de nadere gegevens waarvan sprake in de velden 9 en 15 tot en met 18 van tabel 2 van de bijlage eveneens beschouwd als nadere ordegegevens waarop dat verzoek betrekking heeft.

*Artikel 14***Inwerkingtreding en toepassing**

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Zij is van toepassing vanaf de datum waarvan sprake in artikel 55, lid 2, van Verordening (EU) nr. 600/2014.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 24 juni 2016

Voor de Commissie  
De voorzitter  
Jean-Claude JUNCKER

## BIJLAGE

Tabel 1

## Legende voor tabel 2

SYMBOOL	GEGEVENS SOORT	DEFINITIE
{ALPHANUM-n}	Maximaal n alfanumerieke tekens	Veld voor vrije tekst.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerieke tekens	drieletterige valutacode volgens ISO 4217 valutacodes
{DATE_TIME_FORMAT}	Datum- en tijdformaat volgens ISO 8601	Datum en tijdstip in het volgende formaat: JJJJ-MM-DDTuu:mm:ss.dddddZ. — „JJJJ” is het jaar; — „MM” is de maand; — „DD” is de dag; — „T” betekent dat de letter „T” wordt gebruikt — „uu” is het uur; — „mm” is de minuut; — „ss.ddddd” is de seconde en de fractie van een seconde; — Z is het UTC-tijdstip. Datums en tijdstippen moeten worden uitgedrukt in UTC.
{DATEFORMAT}	Datumformaat volgens ISO 8601	Datums worden weergegeven in het volgende formaat: JJJJ-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimaal getal van maximaal n cijfers in totaal, waarvan maximaal m cijfers fractiecijfers kunnen zijn.	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve waarden. — het decimaalteken is een punt „.”; — negatieve getallen worden voorafgegaan door „-” (minus); — waarden worden afgerond, niet afgebroken.
{INTEGER-n}	Geheel getal van maximaal n tekens in totaal	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve gehele waarden.
{ISIN}	12 alfanumerieke tekens	ISIN-code volgens ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerieke tekens	Identificatiecode juridische entiteit volgens ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerieke tekens	Marktidentificatiecode volgens ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alfanumerieke tekens	De identifier wordt beschreven in artikel 6 en bijlage II bij de Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie <sup>(1)</sup>

<sup>(1)</sup> Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie van 28 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor de melding van transacties aan de bevoegde autoriteiten (zie bladzijde 449 van dit Publicatieblad).

Tabel 2

## Nadere gegevens over orders

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
<b>Deel A — Identificatie van de relevante partijen</b>			
1	Identificatie van de entiteit die de order heeft ingelegd	De identiteit van het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform. In geval van directe elektronische toegang (Direct Electronic Access, DEA) is de identiteit die van de aanbieder van DEA.	{LEI}
2	Directe elektronische toegang (DEA)	„waar” indien de order bij het handelsplatform is ingelegd met gebruikmaking van DEA als gedefinieerd in artikel 4, lid 1, punt 41, van Richtlijn 2014/65/EU. „onwaar” indien de order bij het handelsplatform niet is ingelegd met gebruikmaking van DEA als gedefinieerd in artikel 4, lid 1, punt 41, van Richtlijn 2014/65/EU.	„waar” „onwaar”
3	Identificatiecode cliënt	Gebruikte code ter identificatie van de cliënt van het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform. Ingeval er een DEA is, wordt de code van de DEA-gebruiker gebruikt Indien de cliënt een juridische entiteit is, wordt de LEI-code van de cliënt gebruikt. Indien de cliënt geen juridische entiteit is, wordt de {NATIONAL_ID} gebruikt. In geval van geaggregeerde orders wordt gebruikgemaakt van de afkorting AGGR als gespecificeerd in artikel 2, lid 3, van deze verordening. In geval van hangende toewijzingen wordt gebruikgemaakt van de afkorting PNAL als gespecificeerd in artikel 2, lid 2, van deze verordening. Dit veld wordt alleen blank gelaten als het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform geen cliënt heeft.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR” — geaggregeerde orders „PNAL” — hangende toewijzingen
4	Beleggingsbesluit binnen het bedrijf	Gebruikte code ter identificatie van de persoon of het algoritme binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die/ dat verantwoordelijk is voor het beleggingsbesluit overeenkomstig artikel 8 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590. Indien een natuurlijke persoon binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform verantwoordelijk is voor het beleggingsbesluit wordt de persoon die verantwoordelijk is of de eerste verantwoordelijkheid heeft voor het beleggingsbesluit aan de hand van de NATIONAL_ID geïdentificeerd Indien een algoritme verantwoordelijk was voor het beleggingsbesluit wordt het veld ingevuld als beschreven in artikel 8 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590. Dit veld wordt blank gelaten wanneer het beleggingsbesluit niet is genomen door een persoon of een algoritme binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform.	{NATIONAL_ID} — Natuurlijke personen {ALPHANUM-50} — Algoritmen
5	Uitvoering binnen het bedrijf	Gebruikte code ter identificatie van de persoon of het algoritme binnen het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die/ dat verantwoordelijk is voor de uitvoering van de transactie die uit de order voortvloeit overeenkomstig artikel 9 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590. Indien een natuurlijke persoon verantwoordelijk is voor de uitvoering van de transactie, wordt de persoon geïdentificeerd aan de hand van de {NATIONAL_ID}	{NATIONAL_ID} — Natuurlijke personen {ALPHANUM-50} — Algoritmen



N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		<p>Indien een algoritme verantwoordelijk is voor de uitvoering van de transactie wordt dit veld ingevuld in overeenstemming met artikel 9 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590.</p> <p>Indien meer dan één persoon of een combinatie van personen en algoritmen betrokken zijn bij de uitvoering van de transactie, bepaalt het lid van of de deelnemer aan of de cliënt van het handelsplatform de handelaar of het algoritme die/dat in de eerste plaats verantwoordelijk is, als gespecificeerd in artikel 9, lid 4, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590, en wordt in dit veld de identiteit van die handelaar of dat algoritme ingevuld.</p>	
6	Niet-uitvoerende makelaar	<p>Overeenkomstig artikel 2, onder d).</p> <p>Dit veld wordt blank gelaten wanneer het niet van toepassing is.</p>	{LEI}

### Deel B — Handelshoedanigheid en liquiditeitsverschaffing

7	Handelshoedanigheid	<p>Hiermee wordt aangegeven of het inleggen van de order resulteert uit het feit dat het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform matched principal trading uitvoert op grond van artikel 4, lid 38, van Richtlijn 2014/65/EU of voor eigen rekening handelt op grond van artikel 4, lid 6, van Richtlijn 2014/65/EU.</p> <p>Indien het inleggen van de order niet resulteert uit het feit dat het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform matched principal trading uitvoert of voor eigen rekening handelt, wordt in het veld vermeld dat de transactie in een andere hoedanigheid is uitgevoerd.</p>	<p>„DEAL” — Handelen voor eigen rekening</p> <p>„MTCH” — Matched principal</p> <p>„AOTC” — Een andere hoedanigheid</p>
8	Liquiditeitsverschaffingsactiviteit	<p>Hiermee wordt aangegeven of een order bij een handelsplatform wordt ingelegd als onderdeel van een marketmakingstrategie ingevolge de artikelen 17 en 48 van Richtlijn 2014/65/EU, of wordt ingelegd als onderdeel van een andere activiteit overeenkomstig artikel 3 van deze verordening.</p>	<p>„waar”</p> <p>„onwaar”</p>

### Deel C — Datum en tijdstip

9	Datum en tijdstip	<p>De datum en het tijdstip voor elke gebeurtenis opgenomen in deel [G] en [K].</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Het aantal cijfers na de „seconden” wordt bepaald overeenkomstig artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574.</p>
---	-------------------	---	---

### Deel D — Geldigheidsperiode en orderbeperkingen

10	Geldigheidsperiode	<p>Good-For-Day: de order verstrijkt aan het einde van de handelsdag waarop zij in het orderboek is opgenomen.</p> <p>Good-Till-Cancelled: de order blijft actief in het orderboek en is uitvoerbaar totdat zij daadwerkelijk wordt geannuleerd.</p>	<p>„DAVY” — Good-For-Day</p> <p>„GTCV” — Good-Till-Cancelled</p>
----	--------------------	--	--

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		<p>Good-Till-Time: de order verstrijkt uiterlijk op een vooraf bepaald tijdstip binnen de huidige handelssessie.</p> <p>Good-Till-Date: de order verstrijkt aan het einde van een gespecificeerde datum.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time: de order verstrijkt op een gespecificeerde datum en tijd.</p> <p>Good After Time: de order is pas actief na een vooraf bepaald tijdstip binnen de huidige handelssessie.</p> <p>Good After Date: de order is pas actief vanaf het begin van een vooraf bepaalde datum.</p> <p>Good After Specified Date and Time: de order is pas actief vanaf een vooraf bepaald tijdstip op een vooraf bepaalde datum.</p> <p>Immediate-Or-Cancel: een order die wordt uitgevoerd na opneming ervan in het orderboek (voor de hoeveelheid die kan worden uitgevoerd) en die niet in het orderboek blijft voor de (eventueel) resterende hoeveelheid die niet is uitgevoerd.</p> <p>Fill-Or-Kill: een order die wordt uitgevoerd na opneming ervan in het orderboek mits zij volledig kan worden uitgevoerd: ingeval de order slechts gedeeltelijk kan worden uitgevoerd, wordt zij automatisch geweigerd en kan zij derhalve niet worden uitgevoerd.</p> <p>Andere: alle bijkomende aanduidingen die uniek zijn voor bepaalde bedrijfsmodellen, handelsplatformen of systemen.</p>	<p>„GTTV” — Good-Till-Time</p> <p>„GTDV” — Good-Till-Date</p> <p>„GTSV” — Good-Till-Specified Date and Time</p> <p>„GATV” — Good After Time</p> <p>„GADV” — Good After Date</p> <p>„GASV” — Good After Specified Date and Time</p> <p>„IOCV” — Immediate-Or-Cancel</p> <p>„FOKV” — Fill-Or-Kill of {ALPHANUM-4} tekens die niet al in gebruik zijn voor de eigen classificatie van het handelsplatform.</p>
11	Orderbeperking	<p>Good For Closing Price Crossing Session: indien een order in aanmerking komt voor de slotveiling.</p> <p>Valid For Auction: de order is alleen actief en kan alleen worden uitgevoerd in veilingfasen (die door het lid van of de deelnemer aan het handelsplatform die de order heeft ingelegd vooraf kunnen worden bepaald, bv. openings- en/slotveilingen en/of intraday veiling).</p> <p>Valid For Continuous Trading only: de order is alleen actief tijdens de doorlopende handel.</p>	<p>„SESR” — Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>„VFAR” — Valid For Auction</p> <p>„VFCR” — Valid For Continuous Trading only</p>

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		Andere: alle bijkomende aanduidingen die uniek zijn voor bepaalde bedrijfsmodellen, handelsplatformen of systemen.	{ALPHANUM-4} tekens die niet al in gebruik zijn voor de eigen classificatie van het handelsplatform.  In dit veld worden, gescheiden door een komma, meerdere afkortingen ingevuld indien meerdere types van toepassing zijn.
12	Geldigheidsperiode en -tijdstip	Dit heeft betrekking op het tijdstempel dat het tijdstip weergeeft waarop de order actief wordt of uiteindelijk uit het orderboek wordt verwijderd  Good for day: de datum van invoering met het tijdstempel onmiddellijk vóór middernacht.  Good till tim: de datum van invoering en het tijdstip gespecificeerd in de order  Good till date: de gespecificeerde datum van afloop met het tijdstempel onmiddellijk vóór middernacht  Good till specified date and time: de gespecificeerde datum en het gespecificeerde tijdstip van afloop  Good after time: de datum van invoering en het gespecificeerde tijdstip waarop de order actief wordt  Good after date: de gespecificeerde datum met het tijdstempel onmiddellijk na middernacht  Good after specified date and time: de gespecificeerde datum en het gespecificeerde tijdstip waarop de order actief wordt  Good till Cancel: de uiteindelijke datum en het uiteindelijke tijdstip waarop de order automatisch wordt verwijderd door marktactiviteiten  Andere: tijdstempel voor een bijkomend geldigheidstype.	{DATE_TIME_FORMAT}  Het aantal cijfers na de „seconden” wordt bepaald overeenkomstig artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574.

**Deel E — Prioriteits- en volgnummer**

13	Prioriteitstijdstempel	Dit veld wordt geactualiseerd telkens wanneer de prioriteit van een order verandert.	{DATE_TIME_FORMAT}  Het aantal cijfers na de „seconden” wordt bepaald overeenkomstig artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574.
14	Prioriteitsomvang	Voor handelsplatformen die omvangs-tijdsrioriteit gebruiken, wordt in dit veld een positief getal ingevuld dat overeenkomt met de hoeveelheid.  Dit veld wordt geactualiseerd telkens wanneer de prioriteit van de order verandert.	Maximaal 20 numerieke positieve cijfers.
15	Volgnummer	Elke gebeurtenis die is opgenomen in deel G wordt geïdentificeerd aan de hand van positieve gehele getallen in opklimmende volgorde.  Het volgnummer is uniek voor elk type gebeurtenis, consistent voor alle gebeurtenissen die door de exploitant van het handelsplatform van een tijdstempel voorzien worden en persistent wat betreft de datum waarop de gebeurtenis zich voordoet.	{INTEGER-50}

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
----	------	---	--

**Deel F — Identificatie van de order**

16	MIC-code van het segment	Identificatie van het handelsplatform waar de order is ingelegd. Als het handelsplatform segment-MIC's gebruikt, wordt de segment-MIC gebruikt. Als het handelsplatform geen segment-MIC's gebruikt, wordt de exploitant-MIC gebruikt.	{MIC}
17	Orderboekcode	De alfanumerieke code die door het handelsplatform voor elk orderboek is vastgesteld.	{ALPHANUM-20}
18	Identificatiecode van het financieel instrument	Unieke en eenduidige identificator van het financieel instrument	{ISIN}
19	Datum van ontvangst	Datum van ontvangst van de oorspronkelijke order.	{DATEFORMAT}
20	Identificatiecode van de order	Een alfanumerieke code die door de exploitant van het handelsplatform aan de individuele order is toegekend	{ALPHANUM-50}

**Deel G — Gebeurtenissen die van invloed zijn op de order**

21	Nieuwe order, orderwijziging, orderannulering, orderverwerkingen, gedeeltelijke of volledige uitvoering	<p>New order: ontvangst van een nieuwe order door de exploitant van het handelsplatform.</p> <p>Triggered: een order die uitvoerbaar wordt casu quo niet-uitvoerbaar wordt wanneer een vooraf bepaalde voorwaarde vervuld wordt.</p> <p>Replaced by the member or participant of the trading venue: indien een lid van, een deelnemer aan of een cliënt van het handelsplatform op eigen initiatief besluit een kenmerk te wijzigen van de order die hij eerder in het orderboek heeft ingevoerd.</p> <p>Replaced by market operations (automatic): indien een kenmerk van een order door de IT-systemen van de exploitant van het handelsplatform wordt gewijzigd. Dit omvat de situatie waarin de actuele kenmerken van een pegorder of een trailing stoporder worden gewijzigd om weer te geven welke plaats de order binnen het orderboek inneemt.</p> <p>Replaced by market operations (human intervention): indien een kenmerk van een order door een medewerker van de exploitant van het handelsplatform wordt gewijzigd. Dit omvat de situatie waarin een lid van of een deelnemer aan het handelsplatform IT-problemen heeft en zijn orders dringend geannuleerd moeten worden.</p> <p>Change of status at the initiative of the member, participant of the trading venue. Dit omvat activering en desactivering.</p>	<p>„NEWO” — New order</p> <p>„TRIG” — Triggered</p> <p>„REME” — Replaced by the member or participant of the trading venue</p> <p>„REMA” — Replaced by market operations (automatic)</p> <p>„REMH” — Replaced by market operations (human intervention)</p> <p>„CHME” — Change of status at the initiative of the member/participant of the trading venue</p>
----	---	---	---

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		<p>Change of status due to market operations.</p> <p>Cancelled at the initiative of the member, participant of the trading venue; indien een lid, deelnemer of cliënt op eigen initiatief besluit de order te annuleren die hij eerder heeft ingevoerd.</p> <p>Cancelled by market operations. Dit omvat een beschermingsmechanisme voor beleggingsondernemingen die een marketmaking-activiteit uitvoeren als neergelegd in de artikelen 17 en 48 van Richtlijn 2014/65/EU.</p> <p>Rejected order: een door de exploitant van het handelsplatform ontvangen maar verworpen order.</p> <p>Expired order: indien de order aan het einde van zijn geldigheidsperiode uit het orderboek wordt verwijderd.</p> <p>Partially filled: indien de order niet volledig wordt uitgevoerd, zodat er nog een hoeveelheid moet worden uitgevoerd.</p> <p>Filled: indien er geen enkele hoeveelheid meer dient te worden uitgevoerd.</p>	<p>„CHMO” — Change of status due to market operations</p> <p>„CAME” — Cancelled at the initiative of the member or participant of the trading venue</p> <p>„CAMO” — Cancelled by market operations</p> <p>„REMO” — Rejected order</p> <p>„EXPI” — Expired order</p> <p>„PARF” — Partially filled</p> <p>„FILL” — Filled</p> <p>{ALPHANUM-4} tekens die niet al in gebruik zijn voor de eigen classificatie van het handelsplatform.</p>

**Deel H — Type order**

22	Ordertype	Hiermee wordt aangegeven welk type order bij het handelsplatform is ingelegd overeenkomstig de specificaties van het handelsplatform.	{ALPHANUM-50}
23	Ordertypeclassificatie	<p>Classificatie van de order volgens twee algemene ordertypes. LIMIEOrder: in de gevallen waarin de order uitvoerbaar is en</p> <p>STOPorder: in de gevallen waarin de order slechts uitvoerbaar wordt wanneer een vooraf bepaalde prijsgebeurtenis intreedt.</p>	De letters „LMTO” voor limiet of de letters „STOP” voor stop.

**Deel I — Prijzen**

24	Limietprijs	<p>De maximumprijs waarop een kooporder kan worden uitgevoerd of de minimumprijs waarop een verkooporder kan worden uitgevoerd.</p> <p>De spreadprijs voor een strategieorder. Deze kan negatief of positief zijn.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als monetaire waarde.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta eenheid gegeven.</p>
----	-------------	--	---

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		<p>In geval van orders die geen limietprijs hebben of in geval van ongeprijsde orders wordt dit veld blank gelaten.</p> <p>In geval van een converteerbare obligatie wordt de voor de order gebruikte werkelijke prijs (zonder of met opgelopen rente) in dit veld weergegeven</p>	<p>{DECIMAL-11/10} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als basispunten</p>
25	Bijkomende limietprijs	Een andere limietprijs die eventueel van toepassing is op de order. Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.	<p>{DECIMAL-18/13} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een monetaire waarde.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta eenheid gegeven.</p> <p>{DECIMAL-11/10} indien de prijs wordt uitgedrukt als percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als basispunten</p>
26	Stopprijs	<p>De prijs die moet worden bereikt wil de order actief worden.</p> <p>Voor stoporders die worden getriggerd door gebeurtenissen die onafhankelijk zijn van de prijs van het financieel instrument, wordt in dit veld een stopprijs gelijk aan nul ingevuld.</p> <p>Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een monetaire waarde.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta eenheid gegeven.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} ingeval de prijs wordt uitgedrukt in basispunten</p>
27	Limietprijs van een pegorder	<p>De maximumprijs waarop een pegorder om te kopen kan worden uitgevoerd of de minimumprijs waarop een pegorder om te verkopen kan worden uitgevoerd.</p> <p>Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een monetaire waarde.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta eenheid gegeven.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als een percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als basispunten</p>

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
28	Transactieprijs	<p>Uitgevoerde prijs van de transactie, in voorkomend geval exclusief provisie en opgelopen rente.</p> <p>In geval van optiecontracten is dit de premie van het derivatencontract per onderliggende waarde of per indexpunt.</p> <p>In geval van spread bets is dit de referentieprijs van het direct onderliggend instrument.</p> <p>Voor credit default swaps (CDS) is dit de coupon in basispunten.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta-eenheid gegeven.</p> <p>Indien de prijs niet van toepassing is, wordt de waarde „NOAP” in het veld ingevuld.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als monetaire waarde.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als basispunten</p> <p>„NOAP”</p>
29	Prijsvaluta	Valuta waarin de transactieprijs voor het financieel instrument met betrekking tot de order wordt uitgedrukt	{CURRENCYCODE_3}
30	Valuta van poot 2	<p>Bij multi-currency of cross-currency swaps is de valuta van poot 2 de valuta waarin poot 2 van het contract luidt.</p> <p>Voor swaptions waarbij de onderliggende swap een multi-currency swap is, is de valuta van poot 2 de valuta waarin poot 2 van de swap luidt.</p> <p>Dit veld moet alleen worden ingevuld indien er rente- en valuta-derivatencontracten zijn.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Eenheid van de prijs	Hiermee wordt aangegeven of de prijs wordt uitgedrukt in monetaire waarde, in percentage, in rendement of in basispunten.	<p>„MONE” — Monetary value</p> <p>„PERC” — Percentage</p> <p>„YIEL” — Yield</p> <p>„BAPO” — Basis points</p>

**Deel J — Orderinstructies**

32	Koop-verkoopindicator	<p>Om te tonen of het om een koop- of verkooporder gaat.</p> <p>In geval van opties en swaptions is de koper de tegenpartij die het recht bezit om de optie uit te oefenen en is de verkoper de tegenpartij die de optie verkoopt en een premie ontvangt.</p> <p>In geval van futures en forwards behalve valutafutures en -forwards is de koper de tegenpartij die het instrument koopt en de verkoper de tegenpartij die het instrument verkoopt.</p> <p>In geval van swaps met betrekking tot effecten is de koper de tegenpartij waarbij het risico van prijsbeweging van het onderliggende effect komt te liggen en die het zekerheidsbedrag ontvangt. De verkoper is de tegenpartij die het zekerheidsbedrag betaalt.</p>	<p>„BUYI” — kopen</p> <p>„SELL” — verkopen</p>
----	-----------------------	---	--

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
		<p>In geval van swaps met betrekking tot rente of inflatie-indices is de koper de tegenpartij die de vaste rente betaalt. De verkoper is de tegenpartij die de vaste rente ontvangt. In geval van basis-swaps (variabel-voor-variabel renteswaps) is de koper de tegenpartij die de spread betaalt en de verkoper de tegenpartij die de spread ontvangt.</p> <p>In geval van swaps en forwards met betrekking tot valuta en van cross currency swaps is de koper de tegenpartij die de valuta ontvangt die op de eerste plaats staat bij alfabetische sortering volgens de ISO 4217-standaard en de verkoper de tegenpartij die deze valuta levert.</p> <p>In geval van swaps met betrekking tot dividenden is de koper de tegenpartij die de gelijkwaardige werkelijke dividenduitkeringen ontvangt. De verkoper is de tegenpartij die het dividend betaalt en de vaste rente ontvangt.</p> <p>In geval van afgeleide instrumenten voor de overdracht van kredietrisico behalve opties en swaptions is de koper de tegenpartij die de protectie koopt. De verkoper is de tegenpartij die de protectie verkoopt.</p> <p>In geval van derivatencontracten in verband met grondstoffen of emissierechten is de koper de tegenpartij die de in het rapport gespecificeerde grondstof of het in het rapport gespecificeerd emissierecht ontvangt en de verkoper de tegenpartij die deze grondstof of dit emissierecht levert.</p> <p>In geval van forward rate agreements is de koper de tegenpartij die de vaste rente betaalt en de verkoper de tegenpartij die de vaste rente ontvangt.</p> <p>Voor een stijging van de notionele waarde is de koper dezelfde als de verkrijger van het financieel instrument bij de oorspronkelijke transactie en de verkoper dezelfde als de vervreemder van het financieel instrument bij de oorspronkelijke transactie.</p> <p>Voor een daling van de notionele waarde is de koper dezelfde als de vervreemder van het financieel instrument bij de oorspronkelijke transactie en de verkoper dezelfde als de verkrijger van het financieel instrument bij de oorspronkelijke transactie.</p>	
33	Orderstatus	<p>Om orders te identificeren die actief/inactief/opgeschort, vast/indicatief (alleen aan bied- en laatprijzen toegewezen)/impliciet/gerouteerd zijn.</p> <p>Actief — niet-prijsgedreven orders die uitvoerbaar zijn.</p> <p>Inactief — niet-prijsgedreven orders die niet uitvoerbaar zijn.</p> <p>Vast/Indicatief — Alleen aan bied- en laatprijzen toegewezen. Indicatieve bied- en laatprijzen zijn zichtbaar, maar kunnen niet worden uitgevoerd. Dit omvat op sommige handelsplatformen warrants. Vaste bied- en laatprijzen kunnen worden uitgevoerd.</p> <p>Impliciet — Gebruikt voor strategieorders uit hoofde van de functionaliteit „implied in” of „implied out”.</p> <p>Gerouteerd — Gebruikt voor orders die door het handelsplatform naar andere platformen worden gerouteerd.</p>	<p>„ACTI” — actief of „INAC” — inactief of „FIRM” — vaste bied- en laatprijzen of „INDI” — indicatieve bied- en laatprijzen of „IMPL” — geïmpliceerde strategieorders of „ROUT” — gerouteerde orders.</p> <p>Als meerdere statussen van toepassing zijn, worden in dit veld meerdere afkortingen ingevuld, gescheiden door een komma</p>



N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
34	Eenheid van de hoeveelheid	Hiermee wordt aangegeven of de gerapporteerde hoeveelheid in aantal eenheden, als een nominale waarde of als een monetaire waarde wordt uitgedrukt.	„UNIT” — Aantal eenheden „NOML” — Nominale waarde „MONE” — Monetaire waarde
35	Valuta van de hoeveelheid	Valuta waarin de hoeveelheid wordt uitgedrukt. Dit veld dient alleen te worden ingevuld indien de hoeveelheid is uitgedrukt als een nominale of monetaire waarde.	{CURRENCYCODE_3}
36	Initiële hoeveelheid	Het aantal eenheden van het financieel instrument, of het aantal derivatencontracten in de order. De nominale of monetaire waarde van het financieel instrument. Voor spread bets is de hoeveelheid gelijk aan de ingezette monetaire waarde per punt beweging in het onderliggend financieel instrument. Voor een stijging of daling van de notionele waarde van derivatencontracten geeft het getal de absolute waarde van de wijziging weer en wordt het als een positief getal uitgedrukt. Voor credit default swaps is de hoeveelheid het notionele bedrag waarvoor de protectie wordt verkregen of vervreemd.	{DECIMAL-18/17} ingeval de hoeveelheid wordt uitgedrukt als aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} ingeval de hoeveelheid wordt uitgedrukt als monetaire of nominale waarde.
37	Resterende hoeveelheid inclusief verborgen hoeveelheid	De totale hoeveelheid die in het orderboek blijft na een gedeeltelijke uitvoering of in geval van een andere gebeurtenis die van invloed is op de order. Bij een gebeurtenis van gedeeltelijke uitvoering is dit het totale resterende volume na die gedeeltelijke uitvoering. Bij invoering van een order is deze gelijk aan de initiële hoeveelheid.	{DECIMAL-18/17} ingeval de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als monetaire of nominale waarde.
38	Weergegeven hoeveelheid	De hoeveelheid die zichtbaar (in tegenstelling tot verborgen) is in het orderboek.	{DECIMAL-18/17} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een monetaire of nominale waarde.
39	Verhandelde hoeveelheid	Bij gedeeltelijke of volledige uitvoering wordt in dit veld de uitgevoerde hoeveelheid ingevuld.	{DECIMAL-18/17} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een monetaire of nominale waarde.
40	Minimaal aanvaardbare hoeveelheid	De minimaal aanvaardbare hoeveelheid opdat een order kan worden uitgevoerd, waarbij het om meerdere gedeeltelijke uitvoeringen kan gaan en normaliter alleen om niet-persistente ordertypes gaat. Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.	{DECIMAL-18/17} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een monetaire of nominale waarde.

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
41	Minimaal uitvoerbare omvang (MES)	De minimale uitvoeringsomvang van een individuele potentiële uitvoering. Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.	{DECIMAL-18/17} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een aantal eenheden. {DECIMAL-18/5} indien de hoeveelheid wordt uitgedrukt als een monetaire of nominale waarde.
42	MES alleen voor de eerste uitvoering	Hiermee wordt gespecificeerd of de MES alleen relevant is voor de eerste uitvoering. Dit veld kan blank worden gelaten indien veld 41 blank is gelaten.	„waar” „onwaar”
43	Alleen passieve indicator	Geeft aan of de order bij het handelsplatform wordt ingelegd met een kenmerk/markering, zodat de order niet onmiddellijk tegen een zichtbaar tegenorder wordt uitgevoerd.	„waar” „onwaar”
44	Indicator van passief of agressief order	Geeft, bij gebeurtenissen van gedeeltelijke uitvoering en uitvoering, aan of de order reeds in het orderboek berustte en liquiditeit verschaft (passief order) dan wel of de order de transactie initieerde en aldus liquiditeit onttrok (agressief order). Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.	„PASV” — passief of „AGRE” — actief.
45	Voorkoming van zelfuitvoering	Geeft aan of de order is ingevoerd met criteria om zelfuitvoering te voorkomen zodat zij niet zou worden uitgevoerd met een order aan de tegenoverliggende zijde van het boek die door hetzelfde lid of dezelfde deelnemer is ingevoerd.	„waar” „onwaar”
46	Strategiegekoppelde orderidentificatie	De alfanumerieke code ten behoeve van het koppelen van alle gerelateerde orders die deel uitmaken van een strategie ingevolge artikel 7, lid 2.	{ALPHANUM-50}
47	Routeringsstrategie	De toepasselijke routeringsstrategie overeenkomstig de specificaties van het handelsplatform. Dit veld wordt blank gelaten als het niet relevant is.	{ALPHANUM-50}
48	Transactie-identificatiecode van het handelsplatform	Alfanumerieke code die door het handelsplatform aan de transactie is toegekend ingevolge artikel 12 van deze verordening. De transactie-identificatiecode van het handelsplatform is uniek, consistent en persistent voor elke segment-MIC volgens ISO 10383 en voor elke handelsdag. Indien het handelsplatform geen segment-MIC's gebruikt, is de transactie-identificatiecode van het handelsplatform uniek, consistent en persistent voor elke exploitant-MIC en elke handelsdag. De identiteit van de tegenpartijen bij de transactie waaraan de code wordt toegekend kan niet uit de componenten van de transactie-identificatiecode worden afgeleid.	{ALPHANUM-52}

N.	Veld	Inhoud van de nadere gegevens over orders die ter beschikking moeten worden gehouden van de bevoegde autoriteit	Normen en formaten voor de nadere gegevens over orders die moeten worden gebruikt bij het op verzoek verstrekken van de relevante ordergegevens aan de bevoegde autoriteit
----	------	---	--

**Deel K — Handelsfasen, indicatieve veilingprijs en -volume**

49	Handelsfasen	De naam van elk van de verschillende handelsfasen tijdens welke een order in het orderboek aanwezig is inclusief handelsonderbrekers, circuit breakers en opschortingen.	{ALPHANUM-50}
50	Indicatieve veilingprijs	De slotprijs met betrekking tot het financieel instrument waarvoor een of meer orders zijn geplaatst.	<p>{DECIMAL-18/5} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als monetaire of nominale waarde.</p> <p>Indien de prijs monetair wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta-eenheid gegeven.</p> <p>{DECIMAL-11/10} ingeval de prijs wordt uitgedrukt als percentage of rendement</p>
51	Indicatief veilingvolume	Het volume (aantal eenheden van het financieel instrument) dat kan worden uitgevoerd op de indicatieve veilingprijs in veld 50 als de veiling precies op dat tijdstip is geëindigd.	<p>{DECIMAL-18/17} ingeval de hoeveelheid wordt uitgedrukt als aantal eenheden.</p> <p>{DECIMAL-18/5} ingeval de hoeveelheid wordt uitgedrukt als monetaire of nominale waarde.</p>