

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2017/580**z dnia 24 czerwca 2016 r.****uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie przechowywania właściwych danych dotyczących zleceń, których przedmiotem są instrumenty finansowe****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniające rozporządzenie (UE) nr 648/2012 ⁽¹⁾, w szczególności jego art. 25 ust. 3 akapit czwarty,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Operatorzy systemów obrotu powinni mieć swobodę w decydowaniu o sposobie przechowywania zapisów właściwych danych dotyczących wszystkich zleceń, których przedmiotem są instrumenty finansowe. Aby jednak umożliwić skuteczne i wydajne gromadzenie, porównywanie i analizowanie właściwych danych dotyczących zleceń do celów monitorowania rynku, informacje te należy udostępniać właściwym organom z wykorzystaniem jednolitych standardów i formatów, w przypadku gdy właściwy organ zażąda tych informacji na podstawie art. 25 ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 600/2014.
- (2) W celu zapewnienia jasności, pewności prawa oraz uniknięcia podwójnego przechowywania tych samych informacji niniejsze rozporządzenie powinno obejmować wszystkie elementy danych dotyczące zleceń, w tym szczegóły, które podlegają zgłoszeniu zgodnie z art. 26 ust. 1 i 3.
- (3) W celu skutecznego wykrywania i badania potencjalnych nadużyć na rynku lub usiłowania tych nadużyć właściwe organy muszą być w stanie bezzwłocznie identyfikować osoby i podmioty, które mogą być w istotnym zakresie zaangażowane w proces realizacji zlecenia, w tym członków lub uczestników systemów obrotu, podmioty odpowiedzialne za decyzje inwestycyjne i decyzje o wykonaniu zlecenia, brokerów niebiorących udziału w wykonaniu zlecenia oraz klientów, w których imieniu zainicjowano zlecenia. Operatorzy systemów obrotu powinni zatem przechowywać oznaczenia używane do identyfikacji tych stron.
- (4) Aby umożliwić właściwym organom skuteczniejszą identyfikację przejawianych przez danego klienta schematów zachowań potencjalnie noszących znamiona nadużyć, w tym również wtedy gdy klient działa za pośrednictwem szeregu firm inwestycyjnych, operatorzy systemów obrotu powinni dokumentować tożsamość klientów, w których imieniu ich członkowie lub uczestnicy przekazują zlecenia. Operatorzy ci powinni identyfikować wspomnianych klientów za pomocą niepowtarzalnych identyfikatorów, aby ułatwić niebudzącą wątpliwości i wydajną identyfikację tych osób, a tym samym ułatwić skuteczniejszą analizę potencjalnych nadużyć na rynku, w które zamieszani mogą być klienci.
- (5) Od operatorów systemów obrotu nie należy wymagać ewidencjonowania identyfikatorów klienta dla wszystkich klientów w łańcuchu transakcji, lecz wyłącznie klientów, w których imieniu członek lub uczestnik systemu obrotu złożył zlecenie.
- (6) Aby umożliwić skuteczne wykrywanie manipulacji na rynku, istotna jest identyfikacja strategii animowania rynku lub podobnych działań. Pozwoli to właściwym organom odróżnić napływ zleceń pochodzących z firmy inwestycyjnej działającej w oparciu o warunki ustalone z góry przez emitenta instrumentu, którego dotyczy zlecenie, lub przez system obrotu, do którego przekazywane jest zlecenie, od napływu zleceń pochodzących z firmy inwestycyjnej działającej według własnego uznania lub według uznania swojego klienta.
- (7) Należy przechowywać zapis dokładnej daty i godziny oraz szczegółowych informacji dotyczących każdego złożenia, modyfikacji, anulowania, odrzucenia i wykonania zlecenia. Pozwoli to na monitorowanie zmian zlecenia przez cały okres jego istnienia, co może odegrać istotną rolę w wykrywaniu i ocenie potencjalnych manipulacji na rynku i praktyk polegających na dokonywaniu własnych transakcji na podstawie wiedzy o zleceniach klientów (ang. *front running*).

⁽¹⁾ Dz.U. L 173 z 12.6.2014, s. 84.

- (8) Aby uzyskać dokładny i pełny obraz arkusza zleceń w systemie obrotu, właściwe organy wymagają informacji dotyczących sesji, podczas których prowadzony jest obrót instrumentami finansowymi. Informacje te można w szczególności wykorzystać do ustalenia momentu rozpoczęcia i zakończenia fazy ustalania kursu jednolitego lub notowań ciągłych oraz stwierdzenia, czy zlecenia powodują nieplanowane uruchomienie automatycznych mechanizmów zawieszania obrotu. Informacje te są również potrzebne, by ustalić sposób interakcji zleceń, zwłaszcza w przypadku gdy sesje kończą się w losowych momentach, jak ma to miejsce np. w fazie ustalania kursu jednolitego. Pomocą w analizie ewentualnych manipulacji w fazie ustalania kursu jednolitego służyć również mogłyby informacje na temat teoretycznych kursów i wolumenów równowagi. Mając na względzie fakt, że pojedyncze zlecenie może wpłynąć na teoretyczny kurs równowagi, teoretyczny wolumen równowagi lub na obie te wartości, właściwe organy muszą widzieć wpływ każdego zlecenia na te wartości. Bez tych informacji trudno byłoby wskazać, które zlecenie wywarło na nie wpływ. Ponadto każdemu istotnemu zdarzeniu należy przypisać numer kolejny, aby móc ustalić kolejność zdarzeń, w przypadku gdy dwa zdarzenia lub większa ich liczba mają miejsce w tym samym czasie.
- (9) Określenie pozycji zleceń w arkuszu zleceń umożliwia odtworzenie tego arkusza oraz analizę kolejności wykonania zleceń, co stanowi istotny aspekt nadzoru pod kątem nadużyć na rynku. Pozycja przypisana zleceniu zależy od tego, w jaki sposób system obrotu ustala priorytet realizacji zleceń. Dlatego też operatorzy systemów obrotu powinni nadawać priorytet zleceniom w oparciu o metodę, zgodnie z którą o pierwszeństwie realizacji zlecenia decydują kolejno cena/widoczność/czas złożenia zlecenia lub też wielkość/czas złożenia zlecenia, oraz ewidencjonować szczegółowe informacje dotyczące nadanego priorytetu.
- (10) W celu umożliwienia skutecznego monitorowania rynku należy zapewnić możliwość powiązania zleceń z transakcjami, które ich dotyczą. Operatorzy systemów obrotu powinni zatem przechowywać indywidualne kody identyfikacyjne transakcji pozwalające powiązać zlecenia z transakcjami.
- (11) Operatorzy systemów obrotu powinni – dla każdego otrzymanego zlecenia – ewidencjonować i przechowywać informacje o rodzaju zlecenia oraz związane z nim konkretne dyspozycje, które łącznie decydują o tym, w jaki sposób każde zlecenie zostanie przetworzone przez ich mechanizmy zestawiania zleceń, zgodnie z ich własnymi klasyfikacjami. Te szczegółowe informacje mają istotne znaczenie dla właściwych organów, gdyż umożliwią im monitorowanie – w ramach prowadzonego przez nie nadzoru pod kątem nadużyć na rynku – transakcji w arkuszu zleceń danego systemu obrotu, a w szczególności odtworzenie tego, w jaki sposób każde zlecenie zachowuje się w tym arkuszu. Zważywszy jednak na szeroki wachlarz istniejących i potencjalnych nowych rodzajów zleceń opracowanych przez operatorów systemów obrotu oraz szczególne kwestie techniczne związane z tymi nowymi zleceniami, gromadzenie tych szczegółowych informacji w oparciu o systemy wewnętrznej klasyfikacji stosowane przez tych operatorów może obecnie nie pozwolić właściwym organom na odtworzenie w spójny sposób przebiegu transakcji w arkuszu zleceń wszystkich systemów obrotu. Dlatego też, aby zapewnić właściwym organom możliwość dokładnego zlokalizowania każdego zlecenia w arkuszu zleceń, operatorzy systemów obrotu powinni również klasyfikować każde otrzymane zlecenie jako zlecenie z limitem ceny, w przypadku gdy zlecenie znajduje się w obrocie, lub jako zlecenie z limitem aktywacji, w przypadku gdy zlecenie trafia do obrotu dopiero w momencie wystąpienia uprzednio określonego scenariusza cenowego.
- (12) Ze względów spójności oraz w celu zapewnienia sprawnego funkcjonowania rynków finansowych konieczne jest, aby przepisy ustanowione niniejszym rozporządzeniem oraz przepisy ustanowione rozporządzeniem (UE) nr 600/2014 były stosowane od tej samej daty.
- (13) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowią projekty regulacyjnych standardów technicznych przedstawione Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA).
- (14) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia, dokonał analizy potencjalnych powiązanych kosztów i korzyści oraz zwrócił się o opinię do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010⁽¹⁾,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Zakres, standardy i format istotnych informacji dotyczących zleceń

1. Operatorzy systemów obrotu przechowują do dyspozycji swojego właściwego organu szczegóły każdego zlecenia ogłaszanego przez ich systemy, które określono w art. 2–13 i sprecyzowano w załączniku tabela 2 kolumna druga i trzecia, o ile odnoszą się do danego zlecenia.

⁽¹⁾ Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylenia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84).

2. W przypadku gdy właściwe organy zażądamy jakichkolwiek szczegółów, o których mowa w ust. 1, na podstawie art. 25 ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 600/2014, operatorzy systemów obrotu przekazują te szczegóły z wykorzystaniem standardów i formatów określonych w tabeli 2 kolumna czwarta w załączniku do niniejszego rozporządzenia.

Artykuł 2

Wskazanie właściwych stron

1. W odniesieniu do wszystkich zleceń operatorzy systemów obrotu przechowują zapisy dotyczące:
 - a) członka lub uczestnika systemu obrotu, który przekazał zlecenie do systemu obrotu, zidentyfikowanego w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 1;
 - b) osoby lub algorytmu komputerowego u członka lub uczestnika systemu obrotu, do których to osób lub algorytmów wpłynęło zlecenie i które są odpowiedzialne za podjęcie decyzji inwestycyjnej w odniesieniu do danego zlecenia, zidentyfikowanych w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 4;
 - c) osoby lub algorytmu komputerowego u członka lub uczestnika systemu obrotu, które to osoby lub algorytmy są odpowiedzialne za wykonanie danego zlecenia, zidentyfikowanych w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 5;
 - d) członka lub uczestnika systemu obrotu, który przesłał zlecenie w imieniu i na rzecz innego członka lub uczestnika systemu obrotu, zidentyfikowanego jako broker niebiorący udziału w wykonaniu zlecenia w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 6;
 - e) klienta, w którego imieniu członek lub uczestnik systemu obrotu przekazał zlecenie do systemu obrotu, zidentyfikowanego w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 3.
2. W przypadku gdy członek lub uczestnik lub klient systemu obrotu jest upoważniony na mocy przepisów prawa państwa członkowskiego do przypisywania zlecenia swojemu klientowi po przekazaniu zlecenia do systemu obrotu, a nie przypisał jeszcze zlecenia swojemu klientowi w momencie przekazania zlecenia, zlecenie to identyfikuje się w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 3.
3. W przypadku gdy zlecenia przekazuje się razem do systemu obrotu jako zlecenie zbiorcze, zlecenie zbiorcze identyfikuje się w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 3.

Artykuł 3

Charakter, w jakim członkowie lub uczestnicy systemu obrotu zawierają transakcje, oraz działalność z zakresu zapewniania płynności

1. Charakter, w jakim członek lub uczestnik systemu obrotu składa zlecenie, opisuje się w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 7.
2. Poniższe zlecenia identyfikuje się w sposób określony w załączniku tabela 2 pole 8:
 - a) zlecenie przekazane do systemu obrotu przez członka lub uczestnika w ramach strategii animowania rynku na podstawie art. 17 i 48 dyrektywy Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE⁽¹⁾;
 - b) zlecenie przekazane do systemu obrotu przez członka lub uczestnika w ramach innej działalności z zakresu zapewniania płynności prowadzonej na warunkach z góry ustalonych przez emitenta instrumentu, który jest przedmiotem zlecenia, lub przez dany system obrotu.

⁽¹⁾ Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniająca dyrektywę 2002/92/WE i dyrektywę 2011/61/UE (Dz.U. L 173 z 12.6.2014, s. 349).

Artykuł 4

Zapis daty i godziny

1. Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis daty i godziny wystąpienia każdego zdarzenia wymienionego w tabeli 2 pole 21 w załączniku do niniejszego rozporządzenia z dokładnością określoną w art. 2 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/574 ⁽¹⁾, jak określono w tabeli 2 pole 9 w załączniku do niniejszego rozporządzenia. Z wyjątkiem zapisu daty i godziny odrzucenia zleceń przez platformy systemów obrotu, wszystkie zdarzenia, o których mowa w tabeli 2 pole 21 w załączniku do niniejszego rozporządzenia, zapisuje się w oparciu o wskazania zegarów służbowych wykorzystywanych przez mechanizmy zestawiania zleceń funkcjonujące w systemach obrotu.
2. Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis daty i godziny dla każdej pozycji danych wymienionych w tabeli 2 pola 49, 50 i 51 w załączniku do niniejszego rozporządzenia z dokładnością określoną w art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574.

Artykuł 5

Okres ważności i ograniczenia dotyczące zlecenia

1. Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis okresów ważności i ograniczeń dotyczących zleceń, które wymieniono w załączniku tabela 2 pola 10 i 11.
2. Zapisów dat i godzin w odniesieniu do okresów ważności dokonuje się dla każdego okresu ważności, jak określono w załączniku tabela 2 pole 12.

Artykuł 6

Priorytet i numery kolejne

1. Operatorzy systemów obrotu eksploatujący systemy transakcyjne, w których o kolejności realizacji zlecenia decyduje kolejno cena/widoczność/czas złożenia zlecenia, przechowują zapis znacznika czasu priorytetu dla wszystkich zleceń, jak określono w załączniku tabela 2 pole 13. Zapisu znacznika czasu priorytetu dokonuje się z taką samą dokładnością jak określono w art. 4 ust. 1.
2. Operatorzy systemów obrotu eksploatujący systemy transakcyjne, w których o kolejności realizacji zlecenia decyduje kolejno wielkość/czas złożenia zlecenia, przechowują zapis wielkości zlecenia, która decyduje o kolejności zleceń, jak określono w załączniku tabela 2 pole 14, jak również zapis znacznika czasu priorytetu, o którym mowa w ust. 1.
3. Operatorzy systemów obrotu, którzy przy ustalaniu kolejności realizacji zleceń stosują zarówno kryteria cena/widoczność/czas złożenia zlecenia, jak i kryteria wielkość/czas złożenia zlecenia, i którzy wyświetlają zlecenia w swoim arkuszu zleceń w kolejności według czasu złożenia zlecenia, stosują się do przepisów ust. 1.
4. Operatorzy systemów obrotu, którzy przy ustalaniu kolejności realizacji zleceń stosują zarówno kryteria cena/widoczność/czas złożenia zlecenia, jak i kryteria wielkość/czas złożenia zlecenia, i którzy wyświetlają zlecenia w swoim arkuszu zleceń w kolejności według wielkości/czasu złożenia zlecenia, stosują się do przepisów ust. 2.
5. W odniesieniu do wszystkich zdarzeń operatorzy systemów obrotu nadają i przechowują numer kolejny, jak określono w załączniku tabela 2 pole 15.

Artykuł 7

Kody identyfikacyjne zleceń, których przedmiotem są instrumenty finansowe

1. Dla każdego zlecenia operatorzy systemów obrotu przechowują indywidualny kod identyfikacyjny, jak określono w załączniku tabela 2 pole 20. Kod identyfikacyjny jest niepowtarzalny na poziomie arkusza zleceń, dnia sesyjnego i instrumentu finansowego. Stosuje się go od momentu otrzymania zlecenia przez operatora systemu obrotu do momentu usunięcia danego zlecenia z arkusza zleceń. Kod identyfikacyjny stosuje się również do odrzuconych zleceń bez względu na powód ich odrzucenia.

⁽¹⁾ Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/574 z dnia 7 czerwca 2016 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących poziomu dokładności zegarów służbowych (zob. s. 148 niniejszego Dziennika Urzędowego).

2. Operator systemu obrotu przechowuje właściwe szczegóły zleceń strategicznych wykorzystujących mechanizm zleceń implikowanych (ang. *strategy orders with implied functionality*, SOIF), które są podawane do wiadomości publicznej, jak określono w załączniku. W załączniku tabela 2 pole 33 podaje się wzmiankę, że dane zlecenie jest zleceniem implikowanym (ang. *implicit order*).

W momencie wykonania zlecenia SOIF jego szczegóły są przechowywane przez operatora systemu obrotu, jak określono w załączniku.

W momencie wykonania zlecenia SOIF podaje się powiązany ze strategią kod identyfikacyjny zlecenia, używając tego samego kodu identyfikacyjnego dla wszystkich zleceń związanych z daną strategią. Powiązany ze strategią kod identyfikacyjny zlecenia ma postać określoną w załączniku tabela 2 pole 46.

3. Zlecenia przekazane do systemu obrotu umożliwiającego realizację strategii przekierowania zleceń (ang. *routing*) dany system obrotu identyfikuje jako „przekierowane” (ang. *routed*), jak określono w załączniku tabela 2 pole 33, gdy zostaną przekierowane do innego systemu obrotu. Zlecenia przekazane do systemu obrotu umożliwiającego realizację strategii przekierowania zleceń zachowują ten sam kod identyfikacyjny przez cały czas swojego istnienia, niezależnie od tego, czy jakkolwiek niezrealizowana część zlecenia zostaje ponownie dodana do arkusza zleceń.

Artykuł 8

Zdarzenia wpływające na zlecenia, których przedmiotem są instrumenty finansowe

Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis szczegółów, o których mowa w załączniku tabela 2 pole 21, w odniesieniu do nowych zleceń.

Artykuł 9

Rodzaj zlecenia, którego przedmiotem są instrumenty finansowe

1. Dla każdego otrzymanego zlecenia operatorzy systemów obrotu przechowują zapis rodzaju zlecenia, używając własnej klasyfikacji, jak określono w załączniku tabela 2 pole 22.

2. Operatorzy systemów obrotu klasyfikują każde otrzymane zlecenie jako zlecenie z limitem ceny albo zlecenie z limitem aktywacji, jak określono w załączniku tabela 2 pole 23.

Artykuł 10

Ceny dotyczące zleceń

Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis wszystkich szczegółów związanych z cenami, o których mowa w załączniku tabela 2 sekcja I, o ile dotyczą one danych zleceń.

Artykuł 11

Dyspozycje dotyczące zlecenia

Operatorzy systemów obrotu przechowują zapisy wszystkich dyspozycji dotyczących zlecenia otrzymane dla każdego zlecenia, jak określono w załączniku tabela 2 sekcja J.

Artykuł 12

Nadany przez system obrotu kod identyfikacyjny transakcji

Operatorzy systemów obrotu przechowują indywidualny kod identyfikacyjny transakcji dla każdej transakcji będącej wynikiem pełnego lub częściowego wykonania zlecenia, jak określono w załączniku tabela 2 pole 48.

*Artykuł 13***Fazy obrotu oraz teoretyczny kurs i wolumen równowagi**

1. Operatorzy systemów obrotu przechowują zapis szczegółów zlecenia, jak określono w załączniku tabela 2 sekcja K.
2. W przypadku gdy właściwe organy zażądają szczegółów, o których mowa w sekcji K, na podstawie art. 1, za szczegóły dotyczące zlecenia objętego tym żądaniem uznaje się również szczegóły, o których mowa w załączniku tabela 2 pole 9 i pola 15–18.

*Artykuł 14***Wejście w życie i stosowanie**

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie stosuje się od daty, o której mowa w art. 55 akapit drugi rozporządzenia (UE) nr 600/2014.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 24 czerwca 2016 r.

W imieniu Komisji
Jean-Claude JUNCKER
Przewodniczący

ZAŁĄCZNIK

Tabela 1

Objaśnienia do tabeli 2

SYMBOL	RODZAJ DANYCH	DEFINICJA
{ALPHANUM-n}	Maksymalnie n znaków alfanumerycznych	Pole na tekst dowolny.
{CURRENCYCODE_3}	3 znaki alfanumeryczne	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z normą ISO 4217.
{DATE_TIME_FORMAT}	Format daty i czasu zgodnie z ISO 8601	Data i czas w następującym formacie: RRRR-MM-DDThh:mm:ss.dzzzzzzZ. — „RRRR” oznacza rok, — „MM” oznacza miesiąc, — „DD” oznacza dzień, — „T” oznacza, że należy użyć litery „T” — „hh” oznacza godzinę, — „mm” oznacza minutę, — „ss.dzzzzzz” oznacza sekundę i ułamek sekundy, — Z oznacza czas UTC. Datę i czas należy podawać według czasu UTC.
{DATEFORMAT}	Format daty zgodnie z ISO 8601	Daty należy podawać w następującym formacie: RRRR-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Liczba złożona z maksymalnie „n” cyfr, w tym maksymalnie „m” cyfr ułamkowych	Pole numeryczne zarówno dla wartości dodatnich, jak i ujemnych. — separator miejsc dziesiętnych to „.” (przecinek); — liczby ujemne są poprzedzone znakiem „-” (minus); — wartości podaje się zaokrąglone, a nie okrojone.
{INTEGER-n}	Liczba całkowita do n cyfr łącznie	Pole numeryczne dla liczb całkowitych zarówno dodatnich, jak i ujemnych.
{ISIN}	12 znaków alfanumerycznych	Kod ISIN zgodnie z normą ISO 6166.
{LEI}	20 znaków alfanumerycznych	Identyfikator podmiotu prawnego zgodnie z normą ISO 17442.
{MIC}	4 znaki alfanumeryczne	Kod identyfikacyjny rynku zgodnie z normą ISO 10383.
{NATIONAL_ID}	35 znaków alfanumerycznych	Identyfikator określony w art. 6 i załączniku II do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/590 ⁽¹⁾ .

⁽¹⁾ Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/590 z dnia 28 lipca 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących zgłaszania transakcji właściwym organom (zob. s. 449 niniejszego Dziennika Urzędowego).

Tabela 2

Szczegóły zleceń

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
Sekcja A – Wskazanie właściwych stron			
1	Wskazanie podmiotu, który przekazał zlecenie	Tożsamość członka lub uczestnika systemu obrotu. W przypadku bezpośredniego dostępu elektronicznego należy podać tożsamość podmiotu zapewniającego bezpośredni dostęp elektroniczny.	{LEI}
2	Bezpośredni dostęp elektroniczny	„true” (prawda) w przypadku gdy zlecenie przekazano do systemu obrotu za pomocą bezpośredniego dostępu elektronicznego, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 41 dyrektywy 2014/65/UE. „false” (fałsz) w przypadku gdy zlecenia nie przekazano do systemu obrotu za pomocą bezpośredniego dostępu elektronicznego, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 41 dyrektywy 2014/65/UE.	„true” „false”
3	Kod identyfikacyjny klienta	Kod stosowany do identyfikacji klient członka lub uczestnika systemu obrotu. W przypadku stosowania bezpośredniego dostępu elektronicznego należy użyć kodu użytkownika bezpośredniego dostępu elektronicznego. W przypadku gdy klient jest osobą prawną, należy użyć kodu LEI klienta. W przypadku gdy klient nie jest osobą prawną, należy użyć {NATIONAL_ID}. W przypadku zleceń zbiorczych należy użyć flagi AGGR, jak określono w art. 2 ust. 3 niniejszego rozporządzenia. W przypadku oczekujących alokacji należy użyć flagi PNAL, jak określono w art. 2 ust. 2 niniejszego rozporządzenia. Pole to zostawia się niewypełnione tylko wówczas, gdy członek lub uczestnik systemu obrotu nie ma klienta.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR” – zlecenia zbiorcze „PNAL” – oczekujące alokacje
4	Decyzja inwestycyjna w firmie	Kod stosowany do identyfikacji osoby lub algorytmu u członka lub uczestnika systemu obrotu, odpowiedzialnych za podjęcie decyzji inwestycyjnej zgodnie z art. 8 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590. Jeżeli za podjęcie decyzji inwestycyjnej odpowiada osoba fizyczna u członka lub uczestnika systemu obrotu, osobę odpowiedzialną za decyzję inwestycyjną lub osobę, na której spoczywa główna odpowiedzialność za tę decyzję, identyfikuje się za pomocą {NATIONAL_ID}. Jeżeli za podjęcie decyzji inwestycyjnej odpowiadał algorytm, pole to wypełnia się zgodnie z art. 8 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590. Pole to pozostawia się niewypełnione, w przypadku gdy decyzja inwestycyjna nie została podjęta przez osobę lub algorytm u członka lub uczestnika systemu obrotu.	{NATIONAL_ID} – osoby fizyczne {ALPHANUM-50} – algorytmy
5	Wykonanie zlecenia w firmie	Kod stosowany do identyfikacji osoby lub algorytmu u członka lub uczestnika systemu obrotu, odpowiedzialnych za wykonanie transakcji wynikającej z danego zlecenia zgodnie z art. 9 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590. Jeżeli za wykonanie transakcji odpowiada osoba fizyczna, osobę tę identyfikuje się za pomocą {NATIONAL_ID}.	{NATIONAL_ID} – osoby fizyczne {ALPHANUM-50} – algorytmy

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		Jeżeli za wykonanie transakcji odpowiada algorytm, pole to wypełnia się zgodnie z art. 9 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590. Jeżeli w wykonanie zlecenia zaangażowane są co najmniej dwie osoby lub kombinacja osób i algorytmów, członek lub uczestnik, lub klient systemu obrotu ustala maklera lub algorytm, którzy są w pierwszym rzędzie odpowiedzialni, jak określono w art. 9 ust. 4 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/590, i podaje w tym polu tożsamość tego maklera lub algorytmu.	
6	Broker niebiorący udziału w wykonaniu zlecenia	Zgodnie z art. 2 lit. d). Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	{LEI}

Sekcja B – Charakter, w jakim zawarto transakcję, oraz zapewnianie płynności

7	Charakter, w jakim zawarto transakcję	Wskazanie, czy przekazanie zlecenia jest wynikiem prowadzenia przez członka lub uczestnika systemu obrotu obrotu polegającego na zestawianiu zleceń, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 38 dyrektywy 2014/65/UE, lub zawierania przez nich transakcji na własny rachunek, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 6 tej dyrektywy 2014/65/UE. Jeżeli przekazanie zlecenia nie jest wynikiem prowadzenia przez członka lub uczestnika systemu obrotu obrotu polegającego na zestawianiu zleceń, ani zawierania przez nich transakcji na własny rachunek, w polu tym wskazuje się, że transakcję zawarto w innym charakterze.	„DEAL” – zawarcie transakcji na własny rachunek „MTCH” – obrót polegający na zestawianiu zleceń „AOTC” – transakcja zawarta w innym charakterze
8	Działalność z zakresu zapewniania płynności	Wskazanie, czy zlecenie przekazano do systemu obrotu w ramach strategii animowania rynku na podstawie art. 17 i 48 dyrektywy 2014/65/UE czy też w ramach innej działalności prowadzonej zgodnie z art. 3 niniejszego rozporządzenia.	„true” „false”

Sekcja C – Data i godzina

9	Data i godzina	Data i godzina każdego zdarzenia wymienionego w sekcji [G] i [K].	{DATE_TIME_FORMAT} Liczbę cyfr po „sekundach” określa się zgodnie z art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574.
---	----------------	---	--

Sekcja D – Okres ważności i ograniczenia dotyczące zlecenia

10	Okres ważności	Ważne przez dzień (<i>Good-For-Day</i>): zlecenie wygasa z końcem dnia sesyjnego, w którym wprowadzono je do arkusza zleceń. Ważne dopóki nie anulowano (<i>Good-Till-Cancelled</i>): zlecenie pozostaje aktywne w arkuszu zleceń i podlega wykonaniu dopóki nie zostanie faktycznie anulowane.	„DAVY” – ważne przez dzień „GTCV” – ważne dopóki nie anulowano
----	----------------	--	---

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		<p>Ważne do godziny (<i>Good-Till-Time</i>): zlecenie wygasa najpóźniej o z góry określonej godzinie podczas bieżącej sesji.</p> <p>Ważne do daty (<i>Good-Till-Date</i>): zlecenie wygasa na koniec określonego dnia.</p> <p>Ważne do określonej daty i godziny (<i>Good-Till-Specified Date and Time</i>): zlecenie wygasa w określonym dniu o określonej godzinie.</p> <p>Ważne po godzinie (<i>Good After Time</i>): zlecenie staje się aktywne dopiero po z góry określonej godzinie podczas bieżącej sesji.</p> <p>Ważne po dacie (<i>Good After Date</i>): zlecenie staje się dopiero aktywne począwszy od z góry określonego dnia.</p> <p>Ważne po określonej dacie i godzinie (<i>Good After Specified Date and Time</i>): zlecenie staje się aktywne począwszy od z góry określonej godziny w z góry określonym dniu.</p> <p>Wykonaj natychmiast albo anuluj (<i>Immediate-Or-Cancel</i>): zlecenie, które podlega wykonaniu z chwilą wprowadzenia go do arkusza zleceń (w części możliwej do zrealizowania) i które nie pozostaje w arkuszu zleceń w odniesieniu do ewentualnej pozostałej części, która nie została wykonana.</p> <p>Wykonaj w całości albo anuluj (<i>Fill-Or-Kill</i>): zlecenie, które podlega wykonaniu z chwilą wprowadzenia go do arkusza zleceń, pod warunkiem że może zostać wykonane w całości: jeżeli zlecenie może zostać wykonane tylko częściowo, zostaje automatycznie odrzucone i w związku z tym nie może zostać wykonane.</p> <p>Inne: wszelkie dodatkowe wskazania, które są specyficzne dla danego modelu biznesowego, platform lub systemów obrotu.</p>	<p>„GTTV” – ważne do godziny</p> <p>„GTDV” – ważne do daty</p> <p>„GTSV” – ważne do określonej daty i godziny</p> <p>„GATV” – ważne po godzinie</p> <p>„GADV” – ważne po dacie</p> <p>„GASV” – ważne po określonej dacie i godzinie</p> <p>„IOCV” – wykonaj natychmiast albo anuluj</p> <p>„FOKV” – wykonaj w całości albo anuluj lub znaki {ALPHANUM-4}, które nie są jeszcze w użyciu, stosowane na potrzeby własnej klasyfikacji systemu obrotu.</p>
11	Ograniczenia dotyczące zlecenia	<p>Ważne podczas dogrywki po kursie zamknięcia (<i>Good For Closing Price Crossing Session</i>): gdy zlecenie kwalifikuje się do realizacji w fazie dogrywki po cenie równej kursowi zamknięcia.</p> <p>Ważne podczas fazy ustalania kursu jednolitego (<i>Valid For Auction</i>): zlecenie jest aktywne i może zostać wykonane tylko w fazach ustalania kursu jednolitego (które mogą być z góry określone przez członka lub uczestnika systemu obrotu, który przekazał zlecenie, np. faza ustalania kursu jednolitego na otwarciu lub zamknięciu lub śróddzienna faza ustalania kursu jednolitego).</p> <p>Ważne tylko podczas notowań ciągłych (<i>Valid For Continuous Trading only</i>): zlecenie jest aktywne tylko podczas notowań ciągłych.</p>	<p>„SESR” – ważne podczas dogrywki po kursie zamknięcia</p> <p>„VFAR” – ważne podczas fazy ustalania kursu jednolitego</p> <p>„VFCR” – ważne tylko podczas notowań ciągłych</p>

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		Inne: wszelkie dodatkowe wskazania, które są specyficzne dla danego modelu biznesowego, platform lub systemów obrotu.	znaki {ALPHANUM-4}, które nie są jeszcze w użyciu, stosowane na potrzeby własnej klasyfikacji systemu obrotu. Jeżeli jednocześnie obowiązuje kilka ograniczeń, w polu tym podaje się stosowne flagi oddzielone przecinkami.
12	Okres i godzina ważności	<p>Pole to zawiera znacznik czasu wskazujący godzinę, o której zlecenie ulega aktywacji lub ostatecznemu usunięciu z arkusza zleceń.</p> <p>Ważne przez dzień: data wprowadzenia zlecenia do arkusza zleceń ze znacznikiem czasu tuż przed północą.</p> <p>Ważne do godziny: data wprowadzenia zlecenia do arkusza zleceń oraz godzina określona w zleceniu.</p> <p>Ważne do daty: określona data wygaśnięcia ze znacznikiem czasu tuż przed północą.</p> <p>Ważne do określonej daty i godziny: określona data i godzina wygaśnięcia.</p> <p>Ważne po godzinie: data wprowadzenia zlecenia do arkusza zleceń oraz określona godzina, o której zlecenia stanie się aktywne.</p> <p>Ważne po dacie: określona data ze znacznikiem czasu tuż po północy.</p> <p>Ważne po określonej dacie i godzinie: określona data i godzina, kiedy zlecenie staje się aktywne.</p> <p>Ważne dopóki nie anulowano: ostateczna data i godzina, gdy zlecenie zostaje automatycznie usunięte w wyniku operacji rynku.</p> <p>Inne: znacznik czasu dla wszelkich dodatkowych rodzajów ważności zlecenia.</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Liczbę cyfr po „sekundach” określa się zgodnie z art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574.</p>

Sekcja E – Priorytet i numer kolejny

13	Znacznik czasu priorytetu	Pole to aktualizuje się każdorazowo, gdy zmieni się priorytet zlecenia.	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Liczbę cyfr po „sekundach” określa się zgodnie z art. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2017/574.</p>
14	Priorytet według kryterium wielkości	<p>W przypadku systemów obrotu, w których o kolejności realizacji zleceń decyduje kryterium wielkość/czas, w polu tym podaje się liczbę dodatnią odpowiadającą wielkości zlecenia.</p> <p>Pole to aktualizuje się każdorazowo, gdy zmieni się priorytet zlecenia.</p>	Maksymalnie 20 cyfr dodatnich.
15	Numer kolejny	<p>Każde zdarzenie wymienione w sekcji G identyfikuje się za pomocą dodatnich liczb całkowitych w porządku rosnącym.</p> <p>Numer kolejny jest niepowtarzalny dla każdego rodzaju zdarzenia, stosowany jest konsekwentnie w odniesieniu do wszystkich zdarzeń, którym operator systemu obrotu nadał znacznik czasu, oraz jest trwały w odniesieniu do daty, w której wystąpiło dane zdarzenie.</p>	{INTEGER-50}

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
-----	------	--	--

Sekcja F – Identyfikacja zlecenia

16	Kod MIC segmentu	Identyfikacja systemu obrotu, do którego przekazano zlecenie. Jeżeli system obrotu stosuje kody MIC dla segmentów, należy podać MIC segmentu. Jeżeli system obrotu nie stosuje kodów MIC dla segmentów, należy podać operacyjny MIC.	{MIC}
17	Kod arkusza zleceń	Kod alfanumeryczny ustalony przez system obrotu dla każdego arkusza zleceń.	{ALPHANUM-20}
18	Kod identyfikacyjny instrumentu finansowego	Niepowtarzalny i jednoznaczny identyfikator instrumentu finansowego	{ISIN}
19	Data otrzymania	Data otrzymania pierwotnego zlecenia.	{DATEFORMAT}
20	Kod identyfikacyjny zlecenia	Kod alfanumeryczny nadany pojedynczemu zleceniu przez operatora systemu obrotu.	{ALPHANUM-50}

Sekcja G – Zdarzenia wpływające na zlecenie

21	Nowe zlecenie, modyfikacja zlecenia, anulowanie zlecenia, odrzucenie zlecenia, częściowe lub całkowite wykonanie	<p>Nowe zlecenie: otrzymanie nowego zlecenia przez operatora systemu obrotu.</p> <p>Aktywowane: zlecenie, które staje się wykonalne lub, w zależności od przypadku, niewykonalne w momencie spełnienia z góry określonego warunku.</p> <p>Zastąpione przez członka lub uczestnika systemu obrotu: gdy członek, uczestnik lub klient systemu obrotu postanawia z własnej inicjatywy zmienić dowolną cechę zlecenia, które uprzednio wprowadził do arkusza zleceń.</p> <p>Zastąpione w wyniku operacji rynku (automatycznie): gdy dowolna cecha zlecenia zostaje zmieniona przez systemy informatyczne operatora systemu obrotu. Obejmuje to przypadki, gdy dotychczasowe cechy zlecenia typu <i>peg</i> lub zlecenia stop kroczący (<i>trailing stop</i>) zostają zmienione, aby odzwierciedlić pozycję zlecenia w arkuszu zleceń.</p> <p>Zastąpione w wyniku operacji rynku (interwencja człowieka): gdy dowolna cecha zlecenia zostaje zmieniona przez pracowników operatora systemu obrotu. Obejmuje to przypadki, gdy członek, uczestnik systemu obrotu doświadcza problemów informatycznych i musi anulować swoje zlecenia w trybie pilnym.</p> <p>Zmiana statusu z inicjatywy członka, uczestnika systemu obrotu. Obejmuje to aktywację i dezaktywację.</p>	<p>„NEWO” – nowe zlecenie</p> <p>„TRIG” – aktywowane</p> <p>„REME” – zastąpione przez członka lub uczestnika systemu obrotu</p> <p>„REMA” – zastąpione w wyniku operacji rynku (automatycznie)</p> <p>„REMH” – zastąpione w wyniku operacji rynku (interwencja człowieka)</p> <p>„CHME” – zmiana statusu z inicjatywy członka/uczestnika systemu obrotu</p>
----	--	--	---

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		<p>Zmiana statusu w wyniku operacji rynku.</p> <p>Anulowane z inicjatywy członka, uczestnika systemu obrotu; w sytuacji gdy członek, uczestnik lub klient postanawia z własnej inicjatywy anulować zlecenie, które uprzednio wprowadził do arkusza zleceń.</p> <p>Anulowane w wyniku operacji rynku. Obejmuje to mechanizmy ochronne, których stosowania wymaga się od firm inwestycyjnych prowadzących działalność animatora rynku, jak określono w art. 17 i 48 dyrektywy 2014/65/UE.</p> <p>Zlecenie odrzucone: zlecenie otrzymane, lecz odrzucone przez operatora systemu obrotu.</p> <p>Zlecenie wygasłe: zlecenie, które usunięto z arkusza zleceń z upływem jego okresu ważności.</p> <p>Wykonane częściowo: zlecenie, które nie zostało wykonane w pełni, w związku z czym część zlecenia pozostaje do wykonania.</p> <p>Wykonane: sytuacja, w której do wykonania nie pozostała żadna część zlecenia.</p>	<p>„CHMO” – zmiana statusu w wyniku operacji rynku</p> <p>„CAME” – anulowane z inicjatywy członka lub uczestnika systemu obrotu</p> <p>„CAMO” – anulowane w wyniku operacji rynku</p> <p>„REMO” – zlecenie odrzucone</p> <p>„EXPI” – zlecenie wygasłe</p> <p>„PARF” – wykonane częściowo</p> <p>„FILL” – wykonane znaki {ALPHANUM-4}, które nie są jeszcze w użyciu, stosowane na potrzeby własnej klasyfikacji systemu obrotu.</p>

Sekcja H – Rodzaj zlecenia

22	Rodzaj zlecenia	Wskazanie rodzaju zlecenia przekazanego do systemu obrotu zgodnie ze specyfikacjami systemu obrotu.	{ALPHANUM-50}
23	Klasyfikacja rodzaju zlecenia	<p>Klasyfikacja zlecenia według dwóch ogólnych rodzajów zlecenia. Zlecenie z limitem ceny: w przypadku gdy zlecenie znajduje się w obrocie oraz</p> <p>Zlecenie z limitem aktywacji: w przypadku gdy zlecenie trafia do obrotu dopiero w momencie wystąpienia uprzednio określonego scenariusza cenowego.</p>	Zlecenie z limitem ceny oznacza się literami „LMTO”, natomiast zlecenie z limitem aktywacji – „STOP”.

Sekcja I – Ceny

24	Limit ceny	<p>Maksymalny kurs, po którym zlecenie kupna może zostać wykonane, lub minimalny kurs, po którym zlecenie sprzedaży może zostać wykonane.</p> <p>Spread dla zlecenia strategicznego. Może być ujemny lub dodatni.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p>
----	------------	---	--

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		<p>Pole to pozostawia się niewypełnione w przypadku zleceń bez limitu ceny lub zleceń niewycenionych.</p> <p>W przypadku obligacji zamiennych w tym polu podaje się realną cenę (czystą lub brudną) zastosowaną do danego zlecenia.</p>	<p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p> <p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli cena jest wyrażona w punktach bazowych</p>
25	Dodatkowy limit ceny	Każdy inny limit ceny, który może mieć zastosowanie do zlecenia. Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	<p>{DECIMAL-18/13} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p> <p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p> <p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli cena jest wyrażona w punktach bazowych</p>
26	Limit aktywacji	<p>Cena, która musi zostać osiągnięta, aby zlecenie stało się aktywne.</p> <p>W przypadku zleceń z limitem aktywacji, aktywowanych po wystąpieniu zdarzeń niemających związku z ceną instrumentu finansowego, w polu tym podaje się limit aktywacji równy zero.</p> <p>Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p> <p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p> <p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli cena jest wyrażona w punktach bazowych</p>
27	Limit ceny zlecenia typu <i>pegged</i>	<p>Maksymalny kurs, po którym zlecenie kupna typu <i>pegged</i> może zostać wykonane, lub minimalny kurs, po którym zlecenie sprzedaży typu <i>pegged</i> może zostać wykonane.</p> <p>Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p> <p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p> <p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli cena jest wyrażona w punktach bazowych</p>

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
28	Cena transakcyjna	<p>Cena, po której zawarto transakcję, z wyłączeniem, w stosownych przypadkach, prowizji i naliczonych odsetek.</p> <p>W przypadku umów opcji ceną transakcyjną jest premia opcyjna instrumentu pochodnego przypadająca na instrument bazowy lub punkt indeksu.</p> <p>W przypadku instrumentów typu <i>spread bet</i> jest to cena referencyjna bezpośredniego instrumentu bazowego.</p> <p>W przypadku swapów ryzyka kredytowego (CDS) jest to kupon w punktach bazowych.</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p> <p>Jeżeli cena nie ma zastosowania, w polu tym wprowadza się wartość „NOAP”.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.</p> <p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p> <p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli cena jest wyrażona w punktach bazowych</p> <p>„NOAP”</p>
29	Waluta ceny	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena transakcyjna instrumentu finansowego, którego dotyczy zlecenie (ma zastosowanie, jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna).	{CURRENCYCODE_3}
30	Waluta „drugiej nogi”	<p>W przypadku swapów wielowalutowych lub swapów walutowych walutą „drugiej nogi” jest waluta, w której denominowana jest „druga noga” kontraktu.</p> <p>W przypadku opcji na swapy, których aktywem bazowym jest swap wielowalutowy, walutą „drugiej nogi” jest waluta, w której denominowana jest „druga noga” swapu.</p> <p>Pole to wypełnia się wyłącznie w przypadku instrumentów pochodnych stopy procentowej lub pochodnych instrumentów walutowych.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Oznaczenie ceny	Wskazanie, czy cenę wyrażono w wartościach pieniężnych, procentowo, jako stopę zwrotu lub w punktach bazowych.	<p>„MONE” – wartość pieniężna</p> <p>„PERC” – procentowo</p> <p>„YIEL” – stopa zwrotu</p> <p>„BAPO” – punkty bazowe</p>

Sekcja J – Dyspozycje dotyczące zlecenia

32	Oznaczenie zlecenia kupna-sprzedaży	<p>Wskazanie, czy zlecenie jest zleceniem kupna czy zleceniem sprzedaży.</p> <p>W przypadku opcji i opcji na swapy nabywcą jest kontrahent, który ma prawo do wykonania opcji, a wystawcą (sprzedawcą) jest kontrahent, który wystawia opcję i otrzymuje premię opcyjną.</p> <p>W przypadku kontraktów terminowych typu <i>futures</i> i <i>forward</i> innych niż walutowe kontrakty terminowe typu <i>futures</i> i <i>forward</i> nabywcą jest kontrahent, który nabywa dany instrument, a sprzedawcą jest kontrahent, który go sprzedaje.</p> <p>W przypadku swapów dotyczących papierów wartościowych nabywcą jest kontrahent, który ponosi ryzyko zmiany ceny bazowego papieru wartościowego i otrzymuje kwotę stanowiącą równowartość tego papieru. Sprzedawcą jest kontrahent, który wypłaca kwotę stanowiącą równowartość papieru wartościowego.</p>	<p>„BUYI” – zlecenie kupna</p> <p>„SELL” – zlecenie sprzedaży</p>
----	-------------------------------------	---	---

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
		<p>W przypadku swapów dotyczących stóp procentowych lub wskaźników inflacji nabywcą jest kontrahent, który wypłaca odsetki według stałej stopy. Sprzedawcą jest kontrahent, który otrzymuje odsetki według stałej stopy. W przypadku swapów bazowych (swapy stóp procentowych typu zmienna za zmienną) nabywcą jest kontrahent, który płaci spread, a sprzedawcą jest kontrahent, który otrzymuje spread.</p> <p>W przypadku swapów i kontraktów terminowych typu <i>forward</i> dotyczących walut oraz swapów walutowych nabywcą jest kontrahent, który otrzymuje walutę, która znajduje się na pierwszym miejscu po ułożeniu walut w porządku alfabetycznym według normy ISO 4217, a sprzedawcą jest kontrahent, który dostarcza tę walutę.</p> <p>W przypadku swapów dotyczących dywidendy nabywcą jest kontrahent, który otrzymuje kwoty stanowiące równowartość faktycznie wypłacanych dywidend. Sprzedawcą jest kontrahent, który wypłaca dywidendę i otrzymuje odsetki według stałej stopy.</p> <p>W przypadku instrumentów pochodnych dotyczących przeniesienia ryzyka kredytowego, z wyjątkiem opcji i opcji na swapy, nabywcą jest kontrahent, który kupuje ochronę. Sprzedawcą jest kontrahent, który sprzedaje ochronę.</p> <p>W przypadku instrumentów pochodnych dotyczących towarów lub uprawnień do emisji nabywcą jest kontrahent, który otrzymuje towar lub uprawnienie do emisji określone w zgłoszeniu, a sprzedawcą jest kontrahent, który dostarcza towar lub uprawnienie do emisji.</p> <p>W przypadku kontraktów terminowych na stopę procentową nabywcą jest kontrahent, który płaci odsetki według stałej stopy, a sprzedawcą jest kontrahent, który otrzymuje odsetki według stałej stopy.</p> <p>W przypadku wzrostu kwoty referencyjnej nabywca jest tożsamy z nabywcą instrumentu finansowego w pierwotnej transakcji, a sprzedawca jest tożsamy ze zbywcą instrumentu finansowego w pierwotnej transakcji.</p> <p>W przypadku spadku kwoty referencyjnej nabywca jest tożsamy ze zbywcą instrumentu finansowego w pierwotnej transakcji, a sprzedawca jest tożsamy z nabywcą instrumentu finansowego w pierwotnej transakcji.</p>	
33	Status zlecenia	<p>Wskazanie zleceń, które są aktywne/nieaktywne/zawieszane, gwarantowane/orientacyjne (status przypisywany wyłącznie zleceniom animatora rynku(kwotowaniom))/implikowane/przekierowane.</p> <p>Aktywne – zlecenia niebędące kwotowaniem, które znajdują się w obrocie.</p> <p>Nieaktywne – zlecenia niebędące kwotowaniem, które nie znajdują się w obrocie.</p> <p>Gwarantowane/orientacyjne – status przypisywany wyłącznie zleceniom animatora rynku (kwotowaniom). Orientacyjne zlecenia oznaczają zlecenia, która są widoczne, lecz nie mogą zostać wykonane. Dotyczy to m.in. warrantów w niektórych systemach obrotu. Gwarantowane zlecenia mogą zostać wykonane.</p> <p>Implikowane – stosowane w odniesieniu do zleceń strategicznych, które wynikają z funkcjonalności <i>implied in</i> lub <i>implied out</i>.</p> <p>Przekierowane – stosowane w odniesieniu do zleceń, które zostały przekierowane przez system obrotu do innych systemów.</p>	<p>„ACTI” – aktywne lub „INAC” – nieaktywne lub „FIRM” – kwotowania gwarantowane lub „INDI” – kwotowania orientacyjne lub „IMPL” – strategiczne zlecenia implikowane lub „ROUT” – zlecenia przekierowane.</p> <p>Jeżeli zastosowanie ma jednocześnie kilka statusów, w polu tym podaje się stosowne flagi oddzielone przecinkami.</p>

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
34	Oznaczenie ilości	Wskazanie, czy zgłoszoną ilość wyrażono jako liczbę jednostek, jako wartość nominalną czy też jako wartość pieniężną.	„UNIT” – liczba jednostek „NOML” – wartość nominalna „MONE” – wartość pieniężna
35	Waluta ilości	Waluta, w jakiej wyrażono ilość. Pole to wypełnia się tylko wówczas, gdy ilość wyrażono jako wartość nominalną lub pieniężną.	{CURRENCYCODE_3}
36	Początkowa ilość	Liczba jednostek instrumentu finansowego lub liczba instrumentów pochodnych w zleceniu. Wartość nominalna lub pieniężna instrumentu finansowego. Dla instrumentów typu <i>spread bet</i> ilość stanowi wartość pieniężną zakładu postawionego na każdy punkt zmiany ceny bazowego instrumentu finansowego. W przypadku wzrostu lub spadku wartości referencyjnej instrumentów pochodnych liczba ta odzwierciedla wartość bezwzględną zmiany i wyrażona jest jako liczba dodatnia. W przypadku swapów ryzyka kredytowego ilość tą stanowi wartość nominalna, dla której nabyto lub zbyto ochronę.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
37	Pozostała ilość, w tym ukryta	Łączna ilość, która pozostaje w arkuszu zleceń po częściowym wykonaniu zlecenia lub w przypadku wystąpienia każdego innego zdarzenia wpływającego na zlecenie. W przypadku zdarzenia prowadzącego do częściowego wykonania zlecenia jest to łączny pozostały wolumen po tym częściowym wykonaniu. W przypadku wprowadzenia zlecenia do arkusza zleceń jest ona równa ilości początkowej.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
38	Ilość wyświetlana	Ilość, która jest widoczna (czyli nie jest ukryta) w arkuszu zleceń.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
39	Ilość będąca przedmiotem transakcji	W przypadku częściowego lub całkowitego wykonania zlecenia w polu tym podaje się zrealizowaną ilość.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
40	Minimalna dopuszczalna ilość (MAQ)	Minimalna dopuszczalna wielkość zlecenia podlegająca wykonaniu, na którą mogą się składać wielokrotne częściowe wykonania, i zwykle dotyczy wyłącznie kategorii zleceń nietrwałych (<i>non-persistent</i>). Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
41	Minimalna wielkość podlegająca wykonaniu (MES)	Minimalna, podlegająca wykonaniu wielkość każdego pojedynczego potencjalnego wykonania. Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek {DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna
42	MES dotycząca tylko pierwszego wykonania	Wskazanie, czy MES obowiązuje wyłącznie dla pierwszego wykonania. Pola tego można nie wypełniać, jeżeli pole 41 jest puste.	„true” „false”
43	Wskaźnik „tylko pasywne”	Wskazanie, czy zlecenie przekazano do systemu obrotu i opatrzone cechą/flagą, decydującą o tym, że zlecenie nie podlega natychmiastowemu wykonaniu poprzez zestawienie go z dowolnymi przeciwstawnymi widocznymi zleceniami.	„true” „false”
44	Wskaźnik „pasywne lub agresywne”	W przypadku zdarzeń skutkujących częściowym lub całkowitym wykonaniem zlecenia – wskazanie, czy zlecenie figurowało już w arkuszu zleceń i zapewniało płynność (pasywne) czy też zlecenie zainicjowało transakcję i tym samym wykorzystało dostępną płynność (agresywne). Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	„PASV” – pasywne lub „AGRE” – agresywne.
45	Zapobiegnięcie automatycznemu wykonaniu	Wskazanie, czy zlecenie wprowadzono do arkusza zleceń opatrząc je warunkiem zapobiegającym automatycznemu wykonaniu, dzięki czemu zlecenie nie ulegnie wykonaniu w momencie wprowadzenia przez tego samego członka lub uczestnika zlecenia po przeciwnej stronie arkusza zleceń.	„true” „false”
46	Identyfikacja zlecenia powiązanego ze strategią	Alfanumeryczny kod stosowany do powiązania wszystkich pokrewnych zleceń, które stanowią część strategii zgodnie z art. 7 ust. 2.	{ALPHANUM-50}
47	Strategia przekierowania zlecenia	Zastosowana strategia przekierowania zlecenia według specyfikacji systemu obrotu. Pole to pozostawia się niewypełnione, jeżeli nie dotyczy.	{ALPHANUM-50}
48	Nadany przez system obrotu kod identyfikacyjny transakcji	Kod alfanumeryczny nadany transakcji przez system obrotu zgodnie z art. 12 niniejszego rozporządzenia. Nadany przez system obrotu kod identyfikacyjny transakcji jest niepowtarzalny, konsekwentnie stosowany i trwały w odniesieniu do kodu MIC segmentu zgodnie z normą ISO 10383 i dnia sesyjnego. Jeżeli system obrotu nie stosuje kodów MIC dla segmentów, nadawany przez system obrotu kod identyfikacyjny transakcji musi być niepowtarzalny, konsekwentnie stosowany i trwały w odniesieniu do operacyjnego MIC i dnia sesyjnego. Elementy składowe kodu identyfikacji transakcji nie mogą zdradzać tożsamości stron transakcji, dla której przechowywany jest dany kod.	{ALPHANUM-52}

Lp.	Pole	Treść szczegółów zlecenia, które należy przechowywać do dyspozycji właściwego organu	Standardy i formaty szczegółów zlecenia, które należy stosować przy przekazywaniu właściwemu organowi na jego żądanie stosownych danych dotyczących zlecenia
Sekcja K – Fazy obrotu, teoretyczny kurs i wolumen równowagi			
49	Fazy obrotu	Nazwa każdej odrębnej fazy obrotu, podczas której zlecenie jest obecne w arkuszu zleceń, w tym podczas okresów wstrzymania obrotu, uruchomienia automatycznych mechanizmów zawieszania obrotu i zawieszzeń.	{ALPHANUM-50}
50	Teoretyczny kurs równowagi	Cena, która w każdej fazie ustalania kursu jednolitego stanowi kurs równowagi dla instrumentu finansowego, na który złożono jedno zlecenie lub ich większą liczbę.	<p>{DECIMAL-18/5} – jeżeli cena jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna</p> <p>Jeżeli cena wyrażona jest jako wartość pieniężna, podaje się ją w walucie głównej.</p> <p>{DECIMAL-11/10} – jeżeli cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu.</p>
51	Teoretyczny wolumen równowagi	Wolumen (liczba jednostek instrumentu finansowego), który można zrealizować po teoretycznym kursie równowagi podanym w polu 50, gdyby faza ustalania kursu jednolitego zakończyła się w tym konkretnym momencie.	<p>{DECIMAL-18/17} – jeżeli ilość jest wyrażona jako liczba jednostek</p> <p>{DECIMAL-18/5} – jeżeli ilość jest wyrażona jako wartość pieniężna lub nominalna</p>