

REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2017/580 DA COMISSÃO**de 24 de junho de 2016****que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre a manutenção das informações relevantes sobre ordens relativas a instrumentos financeiros****(Texto relevante para efeitos do EEE)**

A COMISSÃO EUROPEIA,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativo aos mercados de instrumentos financeiros e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 ⁽¹⁾, nomeadamente o artigo 25.º, n.º 3, quarto parágrafo,

Considerando o seguinte:

- (1) Os operadores das plataformas de negociação devem ser livres de determinar o modo como mantêm registos das informações relevantes sobre todas as ordens relativas a instrumentos financeiros. No entanto, a fim de permitir uma compilação, comparação e análise eficazes e eficientes das informações relevantes sobre as ordens para efeitos de controlo do mercado, essas informações devem ser disponibilizadas às autoridades competentes utilizando normas e formatos uniformes sempre que a autoridade competente requeira essas informações nos termos do artigo 25.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.
- (2) A fim de garantir clareza e segurança jurídica e de evitar o duplo armazenamento das mesmas informações, o presente regulamento deve abranger todos os elementos das informações relativas a ordens, incluindo informações pormenorizadas que devam ser comunicadas em conformidade com o artigo 26.º, n.ºs 1 e 3.
- (3) A fim de detetar e investigar, de forma eficaz, potenciais abusos de mercado ou tentativas de abuso de mercado, as autoridades competentes têm de identificar imediatamente quaisquer pessoas e entidades suscetíveis de estarem envolvidas de modo significativo no processamento das ordens, incluindo membros ou participantes nas plataformas de negociação, entidades responsáveis pelas decisões de investimento e execução, corretores não encarregados da execução e clientes em nome dos quais sejam iniciadas ordens. Os operadores das plataformas de negociação devem possuir designações para essas partes.
- (4) A fim de permitir que as autoridades competentes identifiquem com maior eficácia padrões suspeitos ou comportamentos potencialmente abusivos com origem num cliente, incluindo quando o cliente opera através de várias empresas de investimento, os operadores das plataformas de negociação devem registar a identidade dos clientes em nome dos quais os seus membros ou participantes apresentaram a ordem. Os operadores devem identificar esses clientes através de identificadores únicos, a fim de facilitar uma identificação correta e eficiente dessas pessoas e uma análise mais eficaz de potenciais abusos de mercado em que os clientes possam estar envolvidos.
- (5) Os operadores das plataformas de negociação não devem ser obrigados a registar identificadores de todos os clientes da cadeia de negociação, mas apenas dos clientes em nome dos quais o membro ou participante apresentou a ordem.
- (6) A identificação das estratégias de criação de mercado ou de atividades semelhantes é importante para permitir uma deteção eficiente da manipulação de mercado. Deste modo, as autoridades competentes podem distinguir o fluxo de ordens provenientes de uma empresa de investimento que atue com base em condições predeterminadas pelo emitente do instrumento que é objeto da ordem ou pela plataforma de negociação através da qual a ordem é apresentada a partir do fluxo de ordens proveniente de uma empresa de investimento que atua segundo critérios próprios ou segundo critérios do cliente.
- (7) O registo da data e hora precisas e das informações pormenorizadas da apresentação, modificação, cancelamento, rejeição e execução das ordens deve ser conservado. Deste modo, é possível acompanhar as alterações à ordem ao longo do seu ciclo de vida, o que pode ser importante para detetar e avaliar possíveis comportamentos de manipulação de mercado e «front running».

⁽¹⁾ JO L 173 de 12.6.2014, p. 84.

- (8) A fim de assegurar que dispõem de uma visão exata e completa da carteira de ordens de uma plataforma de negociação, as autoridades competentes requerem informações sobre sessões de negociação em que sejam negociados instrumentos financeiros. Estas informações podem ser utilizadas para determinar quando iniciam e terminam os períodos de leilão ou de negociação contínua e se as ordens provocam interruptores (*circuit breakers*) não programados. São também necessárias para identificar o modo como as ordens irão interagir, em especial quando as sessões terminam em períodos aleatórios, como no caso dos leilões. Informações relativas a preços aos quais os leilões deveriam conduzir e a volumes suscetíveis de ser executados a estes preços indicativos também ajudariam a analisar possíveis manipulações de leilões. Uma vez que uma única ordem pode influenciar o preço ou o volume ou os dois, as autoridades competentes têm de perceber qual o impacto de cada ordem nestes valores. Sem esta informação, seria difícil identificar qual a ordem que teve impacto nestes valores. Além disso, deveria ser atribuído um número de sequência a cada evento relevante para determinar a sequência de eventos quando ocorrem dois ou mais eventos ao mesmo tempo.
- (9) A especificação da posição das ordens numa carteira de ordens permite a reconstrução da carteira de ordens e a análise da sequência da execução das ordens, que é um elemento importante da vigilância do abuso de mercado. A posição atribuída a uma ordem depende do modo como a prioridade é determinada pelo sistema de negociação. Por conseguinte, os operadores das plataformas de negociação devem atribuir e manter as informações pormenorizadas sobre a prioridade das ordens de acordo com o método de prioridade visibilidade-hora ou dimensão-hora do preço.
- (10) A fim de permitir um controlo de mercado eficaz, é necessário ser capaz de ligar as ordens às transações correspondentes. Os operadores das plataformas de negociação devem manter códigos de identificação das transações distintos que liguem as ordens às transações.
- (11) Os operadores das plataformas de negociação devem, para cada ordem recebida, registar e manter o tipo de ordem e as instruções específicas correspondentes que, em conjunto determinam o modo como cada ordem deverá ser manuseada pelos seus motores de correspondência, em conformidade com as suas próprias classificações. Estas informações pormenorizadas são essenciais para que as autoridades competentes possam acompanhar, no âmbito da vigilância do abuso de mercado, as atividades de negociação numa dada carteira de ordens de uma plataforma de negociação e, em particular, replicar o modo como cada ordem se comporta na carteira de ordens. No entanto, tendo em conta o amplo leque de tipos de ordens existentes e potenciais novos tipos de ordens criados pelos operadores das plataformas de negociação, bem como os aspetos técnicos específicos destes últimos, a manutenção destas informações pormenorizadas de acordo com o sistema de classificação interno dos operadores pode não permitir, atualmente, que as autoridades competentes repliquem a atividade das carteiras de ordens de todas as plataformas de negociação de forma coerente. Por conseguinte, para que as autoridades competentes estejam em condições de localizar exatamente cada ordem na carteira de ordens, os operadores das plataformas de negociação também devem classificar cada ordem recebida como uma ordem com limites caso a ordem seja negociável ou como uma ordem stop caso a ordem se torne negociável apenas após a concretização de um evento de preço predeterminado.
- (12) Por motivos de coerência e para garantir o bom funcionamento dos mercados financeiros, é necessário que as disposições previstas no presente regulamento e as disposições previstas no Regulamento (UE) n.º 600/2014 sejam aplicáveis a partir da mesma data.
- (13) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) à Comissão.
- (14) A ESMA conduziu consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação que servem de base ao presente regulamento, analisou os seus potenciais custos e benefícios e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados, criado pelo artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽¹⁾,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Âmbito de aplicação, normas e formato das informações relevantes sobre as ordens

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter à disposição da respetiva autoridade competente as informações pormenorizadas previstas nos artigos 2.º a 13.º sobre cada ordem anunciada através dos seus sistemas, conforme especificado na segunda e na terceira colunas do quadro 2 do anexo, na medida em que digam respeito à ordem em questão.

⁽¹⁾ Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/77/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

2. Sempre que as autoridades competentes requeiram alguma das informações pormenorizadas a que se refere o n.º 1 em conformidade com o artigo 25.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, os operadores das plataformas de negociação devem facultar essas informações pormenorizadas utilizando as normas e os formatos prescritos na quarta coluna do quadro 2 do anexo ao presente regulamento.

Artigo 2.º

Identificação das partes relevantes

1. Para todas as ordens, os operadores das plataformas de negociação devem manter registos do seguinte:
 - a) O membro ou participante na plataforma de negociação que apresentou a ordem através da plataforma de negociação, identificado conforme especificado no campo 1 do quadro 2 do anexo;
 - b) A pessoa ou o algoritmo pertencente ao membro ou participante na plataforma de negociação através da qual uma ordem é apresentada e que é responsável pela decisão de investimento respeitante à ordem, identificado conforme especificado no campo 4 do quadro 2 do anexo;
 - c) A pessoa ou o algoritmo pertencente ao membro ou participante na plataforma de negociação que é responsável pela execução da ordem, identificado conforme especificado no campo 5 do quadro 2 do anexo;
 - d) O membro ou participante na plataforma de negociação que encaminhou a ordem em nome e por conta de outro membro ou participante na plataforma de negociação, identificado como corretor não encarregado da execução conforme especificado no campo 6 do quadro 2 do anexo;
 - e) O cliente em nome do qual o membro ou participante na plataforma de negociação apresentou a ordem através da plataforma de negociação, identificado conforme especificado no campo 3 do quadro 2 do anexo.
2. Sempre que um membro ou participante ou um cliente da plataforma de negociação está autorizado, nos termos da legislação de um Estado-Membro, a afetar uma ordem ao seu cliente após a apresentação da ordem através da plataforma de negociação e ainda não afetou a ordem ao seu cliente no momento da apresentação da ordem, essa ordem deve ser identificada conforme especificado no campo 3 do quadro 2 do anexo.
3. Sempre que várias ordens são apresentadas através da plataforma de negociação em conjunto como uma ordem agregada, a ordem agregada deve ser identificada conforme especificado no campo 3 do quadro 2 do anexo.

Artigo 3.º

Qualidade em que negociam os membros ou participantes na plataforma de negociação e atividade de fornecimento de liquidez

1. A qualidade em que o membro ou participante na plataforma de negociação apresenta uma ordem deve ser descrita conforme especificado no campo 7 do quadro 2 do anexo.
2. As ordens seguintes devem ser identificadas conforme especificado no campo 8 do quadro 2 do anexo:
 - a) Uma ordem apresentada através de uma plataforma de negociação por um membro ou participante no âmbito de uma estratégia de criação de mercado nos termos dos artigos 17.º e 48.º da Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽¹⁾;
 - b) Uma ordem apresentada através de uma plataforma de negociação por um membro ou participante no âmbito de qualquer outra atividade de fornecimento de liquidez realizada com base em condições predeterminadas pelo emitente do instrumento que é objeto da ordem ou pela plataforma de negociação em questão.

⁽¹⁾ Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativa aos mercados de instrumentos financeiros e que altera a Diretiva 2002/92/CE e a Diretiva 2011/61/UE (JO L 173 de 12.6.2014, p. 349).

Artigo 4.º

Registo da data e da hora

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo da data e da hora da ocorrência de cada evento enumerado no campo 21 do quadro 2 do anexo ao presente regulamento, com o nível de precisão especificado no artigo 2.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574 da Comissão ⁽¹⁾, tal como especificado no campo 9 do quadro 2 do anexo ao presente regulamento. Com exceção do registo da data e da hora da rejeição de ordens pelos sistemas das plataformas de negociação, todos os eventos referidos no campo 21 do quadro 2 do anexo ao presente regulamento devem ser registados recorrendo aos relógios profissionais utilizados pelos motores de correspondência da plataforma de negociação.
2. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo da data e da hora de cada elemento de informação enumerado nos campos 49, 50 e 51 do quadro 2 do anexo ao presente regulamento, com o nível de precisão especificado no artigo 2.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574 da Comissão.

Artigo 5.º

Período de validade e restrições relativas às ordens

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo dos períodos de validade e das restrições relativas às ordens que são enumerados nos campos 10 e 11 do quadro 2 do anexo.
2. Os registos das datas e das horas relativas aos períodos de validade devem ser mantidos conforme especificado no campo 12 do quadro 2 do anexo para cada período de validade.

Artigo 6.º

Prioridade e números de sequência

1. Os operadores das plataformas de negociação que operam sistemas de negociação segundo uma prioridade preço-visibilidade-hora devem manter um registo do carimbo temporal da prioridade para todas as ordens, conforme especificado no campo 13 do quadro 2 do anexo. O carimbo temporal da prioridade deve ser mantido com o mesmo nível de precisão especificado no artigo 4.º, n.º 1.
2. Os operadores das plataformas de negociação que operam sistemas de negociação segundo uma prioridade dimensão-hora devem manter um registo das quantidades que determinam a prioridade das ordens, conforme especificado no campo 14 do quadro 2 do anexo, bem como o carimbo temporal da prioridade mencionado no n.º 1.
3. Os operadores das plataformas de negociação que utilizam uma combinação de prioridade preço-visibilidade-hora e prioridade dimensão-hora e que registam as ordens na sua carteira de ordens segundo uma prioridade temporal devem respeitar o disposto no n.º 1.
4. Os operadores das plataformas de negociação que utilizam uma combinação de prioridade preço-visibilidade-hora e prioridade dimensão-hora e que registam as ordens na sua carteira de ordens segundo uma prioridade dimensão-hora devem respeitar o disposto no n.º 2.
5. Os operadores das plataformas de negociação devem atribuir e manter um número de sequência para todos os eventos, conforme especificado no campo 15 do quadro 2 do anexo.

Artigo 7.º

Códigos de identificação das ordens relativas a instrumentos financeiros

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um código de identificação individual para cada ordem, conforme especificado no campo 20 do quadro 2 do anexo. O código de identificação deve ser único para cada carteira de ordens, para cada dia de negociação e para cada instrumento financeiro. Deve ser aplicável a partir da receção da ordem pelo operador da plataforma de negociação e até à remoção da ordem da carteira de ordens. O código de identificação também deve ser aplicável a ordens rejeitadas, independentemente do motivo da rejeição.

⁽¹⁾ Regulamento Delegado (UE) 2017/574 da Comissão, de 7 de junho de 2016, que complementa a Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação relativas ao nível de precisão dos relógios profissionais (ver página 148 do presente Jornal Oficial).

2. O operador da plataforma de negociação deve conservar os dados relevantes das ordens de estratégia com funcionalidade implícita (SOIF — *strategy orders with implied functionality*) que são divulgadas ao público, conforme especificado no anexo. O campo 33 do quadro 2 do anexo deve incluir uma declaração que indique que a ordem é uma ordem implícita.

Após a execução de uma SOIF, os dados a ela respeitantes devem ser conservados pelo operador da plataforma de negociação conforme especificado no anexo.

Após a execução de uma SOIF, deve ser indicado um código de identificação da ordem ligada à estratégia utilizando o mesmo código de identificação para todas as ordens ligadas a uma dada estratégia. O código de identificação da ordem ligada à estratégia deve ser especificado no campo 46 do quadro 2 do anexo.

3. As ordens apresentadas através de uma plataforma de negociação que permitam uma estratégia de encaminhamento devem ser identificadas por essa plataforma de negociação como «encaminhadas», conforme especificado no campo 33 do quadro 2 do anexo, quando são encaminhadas para outra plataforma de negociação. As ordens apresentadas através de uma plataforma de negociação que permitam uma estratégia de encaminhamento devem manter o mesmo código de identificação durante o seu ciclo de vida, independentemente de ser ou não reinserida uma quantidade remanescente na carteira de ordens inicial.

Artigo 8.º

Eventos que afetam as ordens relativas a instrumentos financeiros

Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo das informações pormenorizadas referidas no campo 21 do quadro 2 do anexo em relação às novas ordens.

Artigo 9.º

Tipo de ordens relativas a instrumentos financeiros

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo do tipo de ordem para cada ordem recebida utilizando a sua própria classificação especificada no campo 22 do quadro 2 do anexo.

2. Os operadores das plataformas de negociação devem classificar cada ordem recebida como uma ordem com limites ou como uma ordem *stop*, conforme especificado no campo 23 do quadro 2 do anexo.

Artigo 10.º

Preços relacionados com as ordens

Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo de todas as informações pormenorizadas relativas a preços referidas no anexo, quadro 2, secção I, na medida em que digam respeito às ordens.

Artigo 11.º

Instruções relativas às ordens

Os operadores das plataformas de negociação devem manter registos de todas as instruções relativas às ordens recebidas para cada ordem, conforme especificado no anexo, quadro 2, secção J.

Artigo 12.º

Código de identificação da transação da plataforma de negociação

Os operadores das plataformas de negociação devem manter um código de identificação da transação individual para cada transação resultante da execução total ou parcial de uma ordem, conforme especificado no campo 48 do quadro 2 do anexo.

*Artigo 13.º***Fases de negociação e preço e volume indicativos de leilão**

1. Os operadores das plataformas de negociação devem manter um registo das informações pormenorizadas relativas às ordens conforme especificado no anexo, quadro 2, secção K.
2. Sempre que as autoridades competentes requirem as informações pormenorizadas referidas na secção K nos termos do artigo 1.º, as informações referidas nos campos 9 e 15 a 18 do quadro 2 do anexo devem também ser consideradas informações pormenorizadas pertencentes à ordem objeto desse pedido.

*Artigo 14.º***Entrada em vigor e aplicação**

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é aplicável a partir da data mencionada no artigo 55.º, segundo parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 24 de junho de 2016.

Pela Comissão
O Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO

Quadro 1

Legenda do Quadro 2

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
{ALPHANUM-n}	Até n caracteres alfanuméricos	Campo para texto livre.
{CURRENCYCODE_3}	3 caracteres alfanuméricos	Código de moeda, de 3 letras, conforme definido pela norma ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato de data e hora da norma ISO 8601	Data e hora no seguinte formato: AAAA-MM-DDThh:mm:ss.dddddZ. — «AAAA» é o ano; — «MM» é o mês; — «DD» é o dia; — «T» — significa que tem de ser utilizada a letra «T» — «hh» é a hora; — «mm» são os minutos; — «ss.ddddd» são os segundos e frações de segundos; — Z é a hora UTC. As datas e as horas têm de ser comunicadas em UTC.
{DATEFORMAT}	Formato de data de acordo com a norma ISO 8601	As datas devem estar formatadas do seguinte modo: AAAA-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Número decimal até um total de n dígitos, dos quais até m dígitos podem ser fracionários	Campo numérico para valores positivos e negativos. — O separador decimal é «,» (vírgula); — os números negativos são prefixados com «-» (menos); — os valores são arredondados e não são truncados.
{INTEGER-n}	Número inteiro até um total de n dígitos	Campo numérico para valores inteiros positivos e negativos.
{ISIN}	12 caracteres alfanuméricos	Código ISIN, conforme definido na norma ISO 6166
{LEI}	20 caracteres alfanuméricos	Identificador de entidade jurídica, conforme definido na norma ISO 17442
{MIC}	4 caracteres alfanuméricos	Identificador de mercado, conforme definido na norma ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 caracteres alfanuméricos	O identificador é o previsto no artigo 6.º e no anexo II do Regulamento Delegado (UE) 2017/590 da Comissão ⁽¹⁾

(1) Regulamento Delegado (UE) 2017/590 da Comissão, de 28 de julho de 2016, que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação para a comunicação de informações sobre as transações às autoridades competentes (ver página 449 do presente Jornal Oficial).

Quadro 2

Detalhes das ordens

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
-----	-------	--	---

Secção A — Identificação das partes relevantes

1	Identificação da entidade que apresentou a ordem	A identidade do membro ou participante na plataforma de negociação. Em caso de acesso eletrónico direto (AED), a identidade deve ser a do prestador do AED.	{LEI}
2	Acesso eletrónico direto (AED)	«Verdadeiro» se a ordem foi apresentada através da plataforma de negociação utilizando AED na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 41, da Diretiva 2014/65/UE. «Falso» se a ordem não foi apresentada através da plataforma de negociação utilizando AED na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 41, da Diretiva 2014/65/UE.	«verdadeiro» «falso»
3	Código de identificação do cliente	Código utilizado para identificar o cliente do membro ou participante na plataforma de negociação. Em caso de existir AED, deve ser utilizado o código do utilizador do AED. Se o cliente for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o código LEI do cliente. Se o cliente não for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o {NATIONAL_ID}. Em caso de ordens agregadas, deve ser utilizado o símbolo AGGR, tal como especificado no artigo 2.º, n.º 3, do presente regulamento. Em caso de afetações pendentes, deve ser utilizado o símbolo PNAL, tal como especificado no artigo 2.º, n.º 2, do presente regulamento. Este campo apenas deve ser deixado em branco se o membro ou participante na plataforma de negociação não tiver um cliente.	{LEI} {NATIONAL_ID} «AGGR» — ordens agregadas «PNAL» — afetações pendentes
4	Decisão de investimento no âmbito da empresa	Código utilizado para identificar a pessoa ou o algoritmo do membro ou participante da plataforma de negociação que é responsável pela decisão de investimento em conformidade com o artigo 8.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/590. Se uma pessoa singular pertencente ao membro ou participante da plataforma de negociação for responsável pela decisão de investimento, a pessoa que é responsável ou é a principal responsável pela decisão de investimento deve ser identificada com o {NATIONAL_ID} Se um algoritmo for responsável pela decisão de investimento, este campo deve ser preenchido em conformidade com o artigo 8.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/590. Este campo deve ser deixado em branco se a decisão de investimento não foi tomada por uma pessoa ou um algoritmo pertencente ao membro ou participante na plataforma de negociação.	{NATIONAL_ID} — Pessoas singulares {ALPHANUM-50} — Algoritmos
5	Execução no âmbito da empresa	Código utilizado para identificar a pessoa ou o algoritmo do membro ou participante da plataforma de negociação que é responsável pela execução da transação resultante da ordem, em conformidade com o artigo 9.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/590. Se uma pessoa singular for responsável pela execução da transação, a pessoa deve ser identificada por {NATIONAL_ID}	{NATIONAL_ID} — Pessoas singulares {ALPHANUM-50} — Algoritmos

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		Se um algoritmo for responsável pela execução da transação, este campo deve ser preenchido em conformidade com o artigo 9.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/590. Se mais do que uma pessoa ou uma combinação de pessoas e algoritmos estiverem envolvidos na execução da transação, o membro, participante ou cliente da plataforma de negociação deve determinar qual o operador ou o algoritmo que é o principal responsável, conforme especificado no artigo 9.º, n.º 4, do Regulamento Delegado (UE) 2017/590 e preencher este campo com a identidade desse operador ou algoritmo.	
6	Corretor não encarregado da execução	Em conformidade com o artigo 2.º, alínea d). Este campo deve ser deixado em branco quando não for relevante.	{LEI}

Secção B — Qualidade em que atua o interveniente na negociação e fornecimento de liquidez

7	Qualidade em que atua o interveniente na negociação	Indica se a apresentação da ordem resulta do facto de o membro ou participante na plataforma de negociação realizar transações simultâneas por conta própria na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 38, da Diretiva 2014/65/UE ou negociação por conta própria na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 6, da mesma diretiva. Se a apresentação da ordem não resulta de o membro ou participante na plataforma de negociação realizar transações simultâneas por conta própria ou negociação por conta própria, este campo deve indicar que a transação foi realizada por um interveniente atuando noutra qualidade.	«DEAL» — Negociação por conta própria «MTCH» — Transações simultâneas por conta própria «AOTC» — Qualquer outra qualidade
8	Atividade de fornecimento de liquidez	Indica se uma ordem é apresentada através de uma plataforma de negociação no âmbito de uma estratégia de criação de mercado nos termos dos artigos 17.º e 48.º da Diretiva 2014/65/UE ou é apresentada como parte de outra atividade em conformidade com o artigo 3.º do presente regulamento.	«verdadeiro» «falso»

Secção C — Data e hora

9	Data e hora	A data e a hora de cada evento enumerado nas secções [G] e [K].	{DATE_TIME_FORMAT} O número de dígitos após os «segundos» deve ser determinado em conformidade com o artigo 2.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574.
---	-------------	---	---

Secção D — Período de validade e restrições relativas às ordens

10	Período de validade	Para o dia: a ordem expira no final do dia de negociação em que é inscrita na carteira de ordens. Até à expiração: a ordem permanece ativa na carteira de ordens e é executável até ser efetivamente cancelada.	«DAVY» — Para o dia «GTCV» — Até à expiração
----	---------------------	--	---

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		<p>Até à hora: a ordem expira o mais tardar numa hora predefinida dentro da sessão de negociação em curso.</p> <p>Até à data: a ordem expira no final de uma data específica.</p> <p>Até uma data e hora especificadas: a ordem expira numa data e hora especificadas.</p> <p>Após a hora: a ordem apenas fica ativa após uma hora predefinida dentro da sessão de negociação em curso.</p> <p>Após a data: a ordem apenas fica ativa a partir do início de uma data predefinida.</p> <p>Após uma data e hora especificadas: a ordem apenas fica ativa a partir de uma hora predefinida numa data predefinida.</p> <p>Executa ou cancela: uma ordem que é executada assim que é inscrita na carteira de ordens (para a quantidade passível de execução) e que não permanece na carteira de ordens para qualquer quantidade restante (se existir) que não tenha sido executada.</p> <p>Tudo ou nada: uma ordem que é executada assim que é inscrita na carteira de ordens, desde que possa ser executada na íntegra: no caso de a ordem poder ser executada apenas parcialmente, é automaticamente rejeitada, não podendo, por conseguinte, ser executada.</p> <p>Outros: outras indicações que sejam próprias de modelos empresariais, plataformas de negociação ou sistemas específicos.</p>	<p>«GTTV» — Até à hora</p> <p>«GTDV» — Até à data</p> <p>«GTSV» — Até uma data e hora especificadas</p> <p>«GATV» — Após a hora</p> <p>«GADV» — Após a data</p> <p>«GASV» — Após uma data e hora especificadas</p> <p>«IOCV» — Executa ou cancela</p> <p>«FOKV» — Tudo ou nada ou {ALPHANUM-4} caracteres que ainda não se encontram em utilização na classificação da plataforma de negociação.</p>
11	Restrições relativas às ordens	<p>Para fase de negociação a preços de fecho: quando uma ordem se qualifica para a fase de negociação a preços de fecho.</p> <p>Válida para leilão: a ordem apenas está ativa e pode ser executada em fases de leilão (que podem ser predefinidas pelo membro ou participante na plataforma de negociação que colocou a ordem, por exemplo, leilões de abertura e/ou de encerramento e/ou leilão intradiário).</p> <p>Válida apenas para negociação contínua: a ordem apenas está ativa durante períodos de negociação contínua.</p>	<p>«SESR» — Para fase de negociação a preços de fecho</p> <p>«VFAR» — Válida para leilão</p> <p>«VFCR» — Válida apenas para negociação contínua</p>

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		Outros: outras indicações que sejam próprias de modelos empresariais, plataformas de negociação ou sistemas específicos.	{ALPHANUM-4} caracteres que ainda não se encontram em utilização na classificação da plataforma de negociação. Este campo deve ser preenchido com vários símbolos, separados por uma vírgula quando existem vários tipos aplicáveis.
12	Período e hora de validade	Refere-se à indicação da hora em que a ordem fica ativa ou em que é retirada da carteira de ordens Para o dia: a data de entrada com a indicação da hora imediatamente antes da meia-noite Até à hora: a data de entrada e a hora até à especificada na ordem Até à data: será a data especificada de caducidade, com a indicação da hora imediatamente antes da meia-noite Até uma data e hora especificadas: a data e a hora de caducidade especificadas Após a hora: a data de entrada e a hora especificada em que a ordem fica ativa Após a data: a data especificada, com a indicação da hora imediatamente após a meia-noite Após uma data e hora especificadas: a data e a hora especificadas em que a ordem fica ativa Até à expiração: a data e hora finais em que a ordem é automaticamente retirada pelas operações de mercado Outros: indicação da hora de outros tipos de validade.	{DATE_TIME_FORMAT} O número de dígitos após os «segundos» é determinado em conformidade com o artigo 2.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574.

Secção E — Prioridade e número de sequência

13	Carimbo temporal da prioridade	Este campo deve ser atualizado sempre que a prioridade de uma ordem é alterada.	{DATE_TIME_FORMAT} O número de dígitos após os «segundos» é determinado em conformidade com o artigo 2.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574.
14	Dimensão da prioridade	Para plataformas de negociação que utilizem prioridade dimensão-hora, este campo deve ser preenchido com um número positivo que corresponda à quantidade. Este campo deve ser atualizado sempre que a prioridade da ordem é alterada.	Até 20 algarismos positivos.
15	Número de sequência	Todos os eventos enumerados na secção G devem ser identificados utilizando números inteiros positivos por ordem crescente. O número de sequência deve ser único para cada tipo de evento; ser coerente para todos os eventos cuja hora tenha sido objeto de carimbo temporal pelo operador da plataforma de negociação; ser persistente para a data em que o evento ocorre.	{INTEGER-50}

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
-----	-------	--	---

Secção F — Identificação da ordem

16	Código MIC de segmento (<i>segment MIC</i>)	Identificação da plataforma de negociação através da qual a ordem foi apresentada. Se a plataforma de negociação utiliza códigos MIC de segmento, este deve ser utilizado. Se a plataforma de negociação não utiliza códigos MIC de segmento, deve ser utilizado o código MIC de exploração (<i>operating MIC</i>)	{MIC}
17	Código da carteira de ordens	O código alfanumérico definido pela plataforma de negociação para cada carteira de ordens.	{ALPHANUM-20}
18	Código de identificação dos instrumentos financeiros	Identificador único e inequívoco do instrumento financeiro	{ISIN}
19	Data de receção	Data de receção da ordem original.	{DATEFORMAT}
20	Código de identificação da ordem	Um código alfanumérico atribuído pelo operador da plataforma de negociação à ordem.	{ALPHANUM-50}

Secção G — Eventos que afetam as ordens

21	Nova ordem, modificação de ordem, cancelamento de ordem, rejeições de ordens, execução parcial ou integral	<p>Nova ordem: receção de uma nova ordem pelo operador da plataforma de negociação.</p> <p>Desencadeada: uma ordem que se torna executável ou, consoante o caso, não executável após a concretização de uma condição predeterminada.</p> <p>Substituída pelo membro ou participante na plataforma de negociação: sempre que um membro, participante ou cliente da plataforma de negociação decide, por sua própria iniciativa, alterar qualquer característica da ordem que inscreveu previamente na carteira de ordens.</p> <p>Substituída por operações de mercado (automáticas): sempre que qualquer característica de uma ordem é alterada pelos sistemas informáticos do operador da plataforma de negociação, incluindo quando as características atuais de uma ordem indexada ou de uma ordem <i>trailing stop</i> são alteradas de modo a refletirem a localização da ordem na carteira de ordens.</p> <p>Substituída por operações de mercado (intervenção humana): sempre que qualquer característica de uma ordem é alterada pelo pessoal do operador da plataforma de negociação, incluindo a situação em que um membro ou participante na plataforma de negociação tem problemas informáticos e precisa que as suas ordens sejam canceladas com urgência.</p> <p>Alteração do estatuto por iniciativa do membro ou participante na plataforma de negociação. Inclui ativação e desativação.</p>	<p>«NEWO» — Nova ordem</p> <p>«TRIG» — Desencadeada</p> <p>«REME» — Substituída pelo membro ou participante na plataforma de negociação</p> <p>«REMA» — Substituída por operações de mercado (automáticas)</p> <p>«REMH» — Substituída por operações de mercado (intervenção humana)</p> <p>«CHME» — Alteração do estatuto por iniciativa do membro/participante na plataforma de negociação</p>
----	--	--	--

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		<p>Alteração do estatuto devido a operações de mercado.</p> <p>Cancelada por iniciativa do membro ou participante na plataforma de negociação; sempre que um membro, participante ou cliente decide, por iniciativa própria, cancelar uma ordem que inscreveu previamente.</p> <p>Cancelada por operações de mercado. Inclui um mecanismo de proteção das empresas de investimento que realizam uma atividade de criação de mercado nos termos dos artigos 17.º e 48.º da Diretiva 2014/65/UE</p> <p>Ordem rejeitada: uma ordem recebida mas rejeitada pelo operador da plataforma de negociação.</p> <p>Ordem expirada: sempre que a ordem é removida da carteira de ordens após o termo do seu período de validade.</p> <p>Parcialmente executada: sempre que a ordem não é executada na íntegra, restando uma determinada quantidade para executar.</p> <p>Executada: sempre que não existe qualquer quantidade remanescente para executar.</p>	<p>«CHMO» — Alteração do estatuto devido a operações de mercado</p> <p>«CAME» — Cancelada por iniciativa do membro ou participante na plataforma de negociação</p> <p>«CAMO» — Cancelada por operações de mercado</p> <p>«REMO» — Ordem rejeitada</p> <p>«EXPI» — Ordem expirada</p> <p>«PARF» — Parcialmente executada</p> <p>«FILL» — Executada {ALPHANUM-4} caracteres que ainda não se encontram em utilização na classificação da plataforma de negociação.</p>

Secção H — Tipo de ordem

22	Tipo de ordem	Identifica o tipo de ordem apresentada à plataforma de negociação, de acordo com as especificações da plataforma de negociação.	{ALPHANUM-50}
23	Classificação do tipo de ordem	<p>Classificação da ordem de acordo com dois tipos genéricos de ordens. Ordem com LIMITES: nos casos em que a ordem é negociável</p> <p>e</p> <p>Ordem STOP: nos casos em que a ordem se torna negociável apenas após a concretização de um evento de preço predeterminado.</p>	As letras «LMTO» para limite ou as letras «STOP» para stop.

Secção I — Preços

24	Preço limite	<p>O preço máximo a que uma ordem de compra pode ser transacionada ou o preço mínimo a que uma ordem de venda pode ser transacionada.</p> <p>O diferencial de preço para uma ordem de estratégia. Pode ser negativo ou positivo.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário.</p> <p>Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal.</p>
----	--------------	--	---

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		Este campo deve ser deixado em branco, no caso de ordens sem limite de preço ou de ordens sem preços. Em caso de obrigação convertível, o preço real (líquido ou bruto) utilizado para esta ordem deve ser refletido neste campo.	{DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento. {DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso como pontos de base.
25	Preço limite adicional	Qualquer outro preço limite que possa ser aplicável à ordem. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário. Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal. {DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento. {DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso como pontos de base.
26	Preço stop	O preço que deve ser alcançado para que ordem se torne ativa. Para ordens stop desencadeadas por eventos independentes do preço do instrumento financeiro, este campo deve ser preenchido com um preço stop igual a zero. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário. Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal. {DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento. {DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso como pontos de base.
27	Preço limite indexado	O preço máximo a que uma ordem indexada de compra pode ser transacionada ou o preço mínimo a que uma ordem de venda indexada pode ser transacionada. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário. Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal. {DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento. {DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso como pontos de base.

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
28	Preço de transação	<p>O preço negociado da transação, deduzido, quando aplicável, das comissões e juros vencidos.</p> <p>No caso de contratos de opção, deve ser o prémio do contrato de derivados por valor mobiliário subjacente ou ponto índice.</p> <p>No caso de <i>spread</i> predefinido, deve ser o preço de referência do instrumento diretamente subjacente.</p> <p>No caso de <i>swaps</i> de risco de incumprimento, deve ser o cupão em pontos base.</p> <p>Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal.</p> <p>Quando o preço não é aplicável, o campo deve ser preenchido com o valor «NOAP».</p>	<p>{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário.</p> <p>{DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento</p> <p>{DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso como pontos de base.</p> <p>«NOAP»</p>
29	Moeda do preço	A moeda em que o preço de negociação do instrumento financeiro relacionado com a ordem é expresso (aplicável quando o preço é expresso como valor monetário).	{CURRENCYCODE_3}
30	Moeda da componente 2	<p>Se houver <i>swaps</i> de múltiplas moedas ou entre moedas, a moeda da componente 2 deve ser a moeda em que a componente 2 do contrato estiver denominada.</p> <p>Para opções sobre <i>swaps</i> em que o subjacente é denominado em várias moedas, a moeda da componente 2 deve ser a moeda em que é denominada a componente 2 do <i>swap</i>.</p> <p>Este campo só deve ser preenchido em caso de existência de contratos de derivados sobre taxas de juro e divisas.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Notação do preço	Indica se o preço é expresso em valor monetário, em percentagem, em rendimento ou em pontos de base.	<p>«MONE» — Valor monetário</p> <p>«PERC» — Percentagem</p> <p>«YIEL» — Rendimento</p> <p>«BAPO» — Pontos de base</p>

Secção J — Instruções relativas às ordens

32	Indicador de compra/venda	<p>Indica se se trata de uma ordem de compra ou de venda.</p> <p>No caso de opções e opções sobre <i>swaps</i>, o comprador é a contraparte que detém o direito de exercer a opção e o vendedor é a contraparte que vende a opção e recebe um prémio.</p> <p>No caso de futuros e contratos a prazo que não sejam relacionados com divisas, o comprador é a contraparte que compra o instrumento e o vendedor é a contraparte que vende o instrumento.</p> <p>No caso de <i>swaps</i> relacionados com valores mobiliários, o comprador é a contraparte que obtém o risco de movimento de preço do valor mobiliário subjacente e recebe o montante do valor mobiliário. O vendedor é a contraparte que paga o montante do valor mobiliário.</p>	<p>«BUYI» — compra</p> <p>«SELL» — venda</p>
----	---------------------------	---	--

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
		<p>No caso de <i>swaps</i> relacionados com taxas de juro ou índices de inflação, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa. O vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa. No caso de <i>swaps</i> de base (<i>swaps</i> de taxas de juro a taxa variável contra taxa variável), o comprador é a contraparte que paga o diferencial e o vendedor é a contraparte que recebe o diferencial.</p> <p>No caso de <i>swaps</i> e contratos a prazo relacionados com divisas e de <i>swaps</i> cambiais, o comprador é a contraparte que recebe a divisa que for a primeira por ordem alfabética de acordo com a norma ISO 4217 e o vendedor é a contraparte que entrega esta divisa.</p> <p>No caso de <i>swaps</i> relacionados com dividendos, o comprador é a contraparte que recebe os pagamentos dos dividendos efetivos equivalentes. O vendedor é a contraparte que paga os dividendos e recebe a taxa fixa.</p> <p>No caso de instrumentos derivados para transferência de risco de crédito, exceto opções e <i>swaps</i> sobre opções, o comprador é a contraparte que compra a proteção. O vendedor é a contraparte que vende a proteção.</p> <p>No caso de contratos de derivados relacionados com mercadorias ou licenças de emissão, o comprador é a contraparte que recebe a mercadoria ou a licença de emissão especificada no relatório e o vendedor é a contraparte que entrega essa mercadoria ou a licença de emissão.</p> <p>No caso de contratos a prazo sobre taxas de juro, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa e o vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa.</p> <p>No caso de um aumento do nocional, o comprador é o mesmo que o adquirente do instrumento financeiro na transação original e o vendedor é o mesmo que o vendedor do instrumento financeiro na transação original.</p> <p>No caso de uma diminuição do nocional, o comprador é o mesmo que o vendedor do instrumento financeiro na transação original e o vendedor é o mesmo que o adquirente do instrumento financeiro na transação original.</p>	
33	Estatuto da ordem	<p>Para identificar ordens ativas/inativas/suspensas, firmes/indicativas (apenas para ofertas de preços)/implícitas/reencaminhadas.</p> <p>Ativa — ordens que não sejam ofertas de preços e que sejam negociáveis.</p> <p>Inativa — ordens que não sejam ofertas de preços e que não sejam negociáveis.</p> <p>Firme/indicativa — apenas para ofertas de preços. Ofertas de preços indicativas são ofertas de preços que são visíveis mais não podem ser executadas. Inclui <i>warrants</i>, em algumas plataformas de negociação. As ofertas de preços firmes podem ser executadas.</p> <p>Implícita — utilizado para ordens de estratégia que são derivadas de uma funcionalidade implícita interna ou externa.</p> <p>Encaminhada — utilizado para ordens que são encaminhadas pela plataforma de negociação para outras plataformas.</p>	<p>«ACTI» — ativa ou «INAC» — inativa ou «FIRM» — ofertas de preços firmes ou «INDI» — ofertas de preços indicativas ou «IMPL» — ordens de estratégia implícitas ou «ROUT» — ordens encaminhadas.</p> <p>Caso sejam aplicáveis vários estatutos, este campo deve ser preenchido com vários símbolos separados por vírgula.</p>

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
34	Notação da quantidade	Indica se a quantidade relatada é expressa em número de unidades, em valor nominal ou em valor monetário.	«UNIT» — Número de unidades «NOML» — Valor nominal «MONE» — Valor monetário
35	Moeda da quantidade	A moeda em que é expressa a quantidade. Este campo apenas deve ser preenchido se a quantidade for expressa em valor nominal ou monetário.	{CURRENCYCODE_3}
36	Quantidade inicial	O número de unidades do instrumento financeiro ou o número de contratos de derivados na ordem. O valor nominal ou monetário do instrumento financeiro. No caso de <i>spread</i> predefinido, a quantidade é o valor monetário calculado por movimento ponto a ponto no instrumento financeiro subjacente. No caso de aumentos ou diminuições em contratos de derivados nocionais, o número deve refletir o valor absoluto da alteração e deve ser expresso em número positivo. No caso de <i>swaps</i> de risco de incumprimento, a quantidade deve ser o montante nocional pelo qual a proteção é adquirida ou alienada.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal
37	Quantidade remanescente, incluindo oculta	A quantidade total que fica na carteira de ordens após uma execução parcial ou em caso de outro evento que afete a ordem. No caso de execução parcial da ordem, deve ser o volume remanescente total após essa execução parcial. No caso de inscrição de uma ordem, deve ser igual à quantidade inicial.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal
38	Quantidade apresentada	A quantidade visível (por oposição à oculta) na carteira de ordens.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal
39	Quantidade negociada	Em caso de execução parcial ou integral, este campo deve ser preenchido com a quantidade executada.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal
40	Quantidade mínima aceitável (MAQ)	A quantidade mínima aceitável para que uma ordem ser executada, que pode consistir em múltiplas execuções parciais e que é normalmente apenas para tipos de ordens não persistentes. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
41	Volume mínimo executável (MES)	O volume mínimo de execução de qualquer potencial execução. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal
42	MES apenas para a primeira execução	Especifica se o MES é relevante apenas para a primeira execução. Este campo pode ser deixado em branco se o campo 41 tiver sido deixado em branco.	«verdadeiro» «falso»
43	Indicador de ordem apenas passiva	Indica se a ordem é apresentada através da plataforma de negociação com uma característica/sinal de tal modo que a ordem não deva ser imediatamente executada contra ordens visíveis contrárias.	«verdadeiro» «falso»
44	Indicador de ordem passiva ou agressiva	Em caso de ordens de execução parcial e total, indica se a ordem já constava da carteira de ordens e fornecia liquidez (passiva) ou se a ordem iniciou a transação e, portanto, recebeu liquidez (agressiva). Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	«PASV» — passiva ou «AGRE» — agressiva.
45	Prevenção de autoexecução	Indica se a ordem foi inscrita com critérios de prevenção de autoexecução, para não execução com uma ordem do lado oposto da carteira de ordens inscrita pelo mesmo membro ou participante.	«verdadeiro» «falso»
46	Identificação de ordem ligada a estratégia	O código alfanumérico utilizado para ligar todas as ordens ligadas que fazem parte de uma estratégia nos termos do artigo 7.º, n.º 2.	{ALPHANUM-50}
47	Estratégia de encaminhamento	A estratégia de encaminhamento aplicável segundo a especificação da plataforma de negociação. Este campo deve ser deixado em branco se não for relevante.	{ALPHANUM-50}
48	Código de identificação da transação da plataforma de negociação	Código alfanumérico atribuído pela plataforma de negociação à transação nos termos do artigo 12.º do presente regulamento. O código de identificação da transação da plataforma de negociação deve ser único, coerente e persistente segundo o código MIC de segmento decorrente da norma ISO 10383 e por dia de negociação. Se a plataforma de negociação não utilizar códigos MIC de segmento, o código de identificação da transação da plataforma de negociação deve ser único, coerente e persistente por código MIC de exploração por dia de negociação. Os componentes do código de identificação da transação não devem revelar a identidade das contrapartes na transação relativamente à qual o código é mantido.	{ALPHANUM-52}

N.º	Campo	O conteúdo das informações pormenorizadas sobre as ordens deverá ser mantido à disposição da autoridade competente	Normas e modelos das informações pormenorizadas sobre as ordens a utilizar aquando da prestação das informações relevantes relativas às ordens à autoridade competente, mediante pedido desta
-----	-------	--	---

Secção K — Fases de negociação e preço e volume indicativos de leilão

49	Fases de negociação	O nome de cada uma das diferentes fases de negociação durante as quais uma ordem está presente na carteira de ordens, incluindo interrupções da negociação, interruptores e suspensões.	{ALPHANUM-50}
50	Preço indicativo de leilão	O preço a que cada leilão deverá conduzir relativamente ao instrumento financeiro para o qual tenham sido apresentadas uma ou mais ordens.	{DECIMAL-18/5} caso o preço seja expresso em valor monetário ou nominal. Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal. {DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento.
51	Volume indicativo de leilão	O volume (número de unidades do instrumento financeiro) que pode ser executado ao preço indicativo de leilão indicado no campo 50 se o leilão terminar nesse preciso momento.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal