

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2017/580

z 24. júna 2016,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy o uchovávaní relevantných údajov týkajúcich sa pokynov súvisiacich s finančnými nástrojmi

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a najmä na jeho článok 25 ods. 3 štvrtý pododsek,

keďže:

- (1) Organizátori obchodných miest by mali mať možnosť slobodne určiť spôsob, akým vedú záznamy o relevantných údajoch týkajúcich sa všetkých pokynov súvisiacich s finančnými nástrojmi. S cieľom umožniť účinné a efektívne zhromažďovanie, porovnávanie a analyzovanie relevantných údajov, ktoré sa týkajú pokynov, na účely monitorovania trhu by sa však tieto informácie mali sprístupniť príslušným orgánom pomocou jednotných štandardov a formátov, ak príslušný orgán požiada o takéto informácie v súlade s článkom 25 ods. 2 nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
- (2) V záujme zabezpečenia zrozumiteľnosti, právnej istoty a zabránenia dvojitému uchovávaniu rovnakých informácií by sa toto nariadenie malo vzťahovať na všetky prvky údajov týkajúce sa pokynov vrátane podrobností, ktoré sa majú oznamovať v súlade s článkom 26 ods. 1 a 3.
- (3) S cieľom účinne odhaliť a preskúmať potenciálne zneužívanie trhu alebo pokus o zneužitie trhu potrebujú príslušné orgány urýchlene identifikovať osoby a subjekty, ktoré sa môžu významnou mierou podieľať na procese zadávania pokynov, vrátane členov alebo účastníkov obchodných miest, subjektov zodpovedných za investičné a vykonávacie rozhodnutia, nevykonávajúcich maklérov a klientov, v mene ktorých boli pokyny iniciované. Organizátori obchodných miest by preto mali viesť zoznam s označením týchto subjektov.
- (4) S cieľom umožniť príslušným orgánom, aby mohli účinnejšie identifikovať podozrivé modely potenciálne zneužívajúceho správania pochádzajúce od jedného klienta vrátane prípadu, keď klient koná prostredníctvom viacerých investičných spoločností, by mali organizátori obchodných miest zaznamenávať identitu klientov, v mene ktorých ich členovia alebo účastníci zadali pokyn. Organizátori by mali identifikovať týchto klientov pomocou jedinečných identifikátorov s cieľom uľahčiť spoľahlivú a efektívnu identifikáciu takýchto osôb a tým uľahčiť účinnejšiu analýzu možného zneužívania trhu, do ktorého môžu byť klienti zapojení.
- (5) Organizátori obchodných miest by nemali byť povinní zaznamenávať identifikátory klientov v prípade všetkých klientov v reťazci obchodov, ale len v prípade klienta, v mene ktorého člen alebo účastník zadal pokyn.
- (6) S cieľom umožniť účinné odhaľovanie manipulácie s trhom je dôležitá identifikácia stratégií tvorby trhu alebo podobných aktivít. To príslušným orgánom umožní odlíšiť tok pokynov prichádzajúci od investičnej spoločnosti konajúcej na základe podmienok vopred určených emitentom nástroja, ktorý je predmetom pokynu, alebo obchodným miestom, ktorému sa pokyn zadal, od toku pokynov prichádzajúceho od investičnej spoločnosti konajúcej z vlastnej iniciatívy alebo z iniciatívy jej klienta.
- (7) Mal by sa uchovávať záznam presného dátumu a času a podrobností akéhokoľvek umiestnenia, zmeny, zrušenia, odmietnutia a vykonania pokynu. To umožní monitorovať počas celého trvania pokynu jeho zmeny, ktoré môžu byť významné pri odhaľovaní a posudzovaní potenciálnej manipulácie s trhom a predbiehania (*front running*).

(¹) Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 84.

- (8) Aby sa zabezpečil presný a úplný obraz o knihe objednávok obchodného miesta, príslušné orgány vyžadujú informácie o intervaloch obchodovania, v rámci ktorých sa obchodujú finančné nástroje. Tieto informácie sa môžu použiť predovšetkým na určenie, kedy začína a končí aukčné obchodovanie alebo kontinuálne obchodovanie, a či pokyny spôsobujú neplánované prerušenie. Tieto informácie sú potrebné aj na to, aby sa určilo, ako budú pokyny vzájomne pôsobiť, najmä ak interval obchodovania končí v náhodných periódach, ako napríklad v prípade aukcií. Tiež informácie o indikatívnych aukčných cenách a objemoch by pomohli pri analýze možnej manipulácie aukcie. Vzhľadom na to, že jediný pokyn môže ovplyvniť aukčnú cenu, aukčný objem alebo oboje, príslušné orgány potrebujú vidieť vplyv každého pokynu na tieto hodnoty. Bez týchto informácií by bolo ťažké určiť, ktorý pokyn ovplyvnil tieto hodnoty. Okrem toho by sa malo každej relevantnej udalosti priradiť poradové číslo s cieľom určiť postupnosť udalostí, keď dve alebo viaceré udalosti nastanú v tom istom čase.
- (9) Upresnenie umiestnenia pokynov v knihe objednávok umožňuje rekonštruovanie knihy objednávok a analýzu postupnosti vykonania pokynov, čo je dôležitým prvkom dohľadu nad zneužívaním trhu. Miesto priradené pokynu závisí od toho, ako systém obchodovania stanovuje prioritu. Preto by mali organizátori obchodných miest priradovať pokynom prioritu a uchovávať podrobné informácie o prioritě pokynov podľa priority určenej viditeľnosťou, cenou a časom alebo podľa metódy priority určenej veľkosťou a časom.
- (10) S cieľom umožniť účinné monitorovanie trhu je potrebné, aby bolo možné prepojiť pokyny s ich príslušnými transakciami. Organizátori obchodných miest by preto mali uchovávať osobitné identifikačné kódy transakcií prepájajúce pokyny s transakciami.
- (11) Organizátori obchodných miest by mali v prípade každého prijatého pokynu zaznamenať a uchovávať typ pokynu a súvisiace osobitné inštrukcie, ktoré spolu určujú, ako majú byť jednotlivé pokyny spracované ich párovacími zariadeniami, a to v súlade s ich vlastnými klasifikáciami. Tieto podrobné informácie sú nevyhnutné na to, aby príslušné orgány mohli ako súčasť svojho dohľadu nad zneužívaním trhu monitorovať obchodnú činnosť v rámci knihy objednávok daného obchodného miesta, a najmä reprodukovať, ako sa jednotlivé pokyny správajú v knihe objednávok. Vzhľadom na širokú škálu existujúcich a potenciálnych nových typov pokynov navrhnutých organizátormi obchodných miest a vzhľadom na osobitné technické aspekty obchodných miest však uchovávanie týchto podrobných informácií podľa vnútorného systému klasifikácie organizátorov v súčasnosti nemusí príslušným orgánom umožňovať reprodukciu činnosti v rámci knihy objednávok všetkých obchodných miest konzistentným spôsobom. Z tohto dôvodu, aby príslušné orgány boli schopné presne lokalizovať každý pokyn v rámci knihy objednávok, by mali organizátori obchodných miest klasifikovať aj každý pokyn prijatý buď ako limitný pokyn, ak je daný pokyn obchodovateľný, alebo ako stop pokyn, ak sa daný pokyn stáva obchodovateľným iba vtedy, keď nastane vopred určená cenová udalosť.
- (12) Z dôvodov konzistentnosti a s cieľom zabezpečiť bezproblémové fungovanie finančných trhov je nevyhnutné, aby sa ustanovenia tohto nariadenia a ustanovenia nariadenia (EÚ) č. 600/2014 uplatňovali od toho istého dátumu.
- (13) Toto nariadenie vychádza z návrhu regulačných technických predpisov, ktorý Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA) predložil Komisii.
- (14) ESMA vykonal otvorené verejné konzultácie k návrhu regulačných technických predpisov, z ktorých toto nariadenie vychádza, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o stanovisko skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov vytvorenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 ⁽¹⁾,

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Rozsah, štandardy a formát relevantných údajov o pokyne

1. Organizátori obchodných miest uchovávajú podrobné údaje o každom pokyne oznamovanom prostredníctvom ich systémov stanovené v článkoch 2 až 13, ako sa uvádza v druhom a treťom stĺpci tabuľky 2 prílohy, pokiaľ sa k danému pokynu vzťahujú, aby boli k dispozícii ich príslušnému orgánu.

⁽¹⁾ Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2009 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Ak príslušné orgány žiadajú akékoľvek údaje uvedené v odseku 1 v súlade s článkom 25 ods. 2 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, organizátori obchodných miest poskytujú tieto údaje s použitím štandardov a formátov stanovených vo štvrtom stĺpci tabuľky 2 prílohy k tomuto nariadeniu.

Článok 2

Určenie príslušných strán

1. Pre všetky pokyny uchovávať organizátori obchodných miest záznamy:
 - a) o členovi alebo účastníkovi obchodného miesta, ktorý obchodnému miestu zadal pokyn, identifikovanom v súlade s poľom 1 tabuľky 2 prílohy;
 - b) o osobe alebo počítačovom algoritme člena alebo účastníka obchodného miesta, ktorému sa pokyn zadal a ktorý je zodpovedný za investičné rozhodnutie v súvislosti s pokynom, tak ako sú identifikované v súlade s poľom 4 tabuľky 2 prílohy;
 - c) o osobe alebo počítačovom algoritme člena alebo účastníka obchodného miesta, ktorý je zodpovedný za vykonanie pokynu, tak ako sú identifikované v poli 5 tabuľky 2 prílohy;
 - d) o členovi alebo účastníkovi obchodného miesta, ktorý smeroval pokyn v mene iného člena alebo účastníka obchodného miesta, identifikovaného ako nevykonávajúci maklér v súlade s poľom 6 tabuľky 2 prílohy;
 - e) o klientovi, v mene ktorého člen alebo účastník obchodného miesta zadal obchodnému miestu pokyn, identifikovanom v súlade s poľom 3 tabuľky 2 prílohy.
2. Ak je člen alebo účastník alebo klient obchodného miesta oprávnený podľa právnych predpisov členského štátu alokovať pokyn svojmu klientovi po zadaní pokynu obchodnému miestu a pri zadaní pokynu ešte nealokoval pokyn svojmu klientovi, takýto pokyn sa identifikuje v súlade s poľom 3 tabuľky 2 prílohy.
3. Ak sa obchodnému miestu zadá viacero pokynov spolu ako súhrnný pokyn, takýto súhrnný pokyn sa identifikuje v súlade s poľom 3 tabuľky 2 prílohy.

Článok 3

Obchodné postavenie členov alebo účastníkov obchodného miesta a činnosť zameraná na zabezpečenie likvidity

1. Obchodné postavenie, v ktorom člen alebo účastník obchodného miesta zadáva pokyn, sa opíše v súlade s poľom 7 tabuľky 2 prílohy.
2. Nasledujúce pokyny sa identifikujú v súlade s poľom 8 tabuľky 2 prílohy:
 - a) pokyn, ktorý obchodnému miestu zadal člen alebo účastník ako súčasť stratégie tvorby trhu podľa článkov 17 a 48 smernice Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ⁽¹⁾;
 - b) pokyn, ktorý obchodnému miestu zadal člen alebo účastník ako súčasť akejkoľvek inej činnosti zameranej na zabezpečenie likvidity vykonávanej na základe podmienok, ktoré vopred stanovil buď emitent nástroja, ktorý je predmetom pokynu, alebo príslušné obchodné miesto.

⁽¹⁾ Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorou sa mení smernica 2002/92/ES a smernica 2011/61/EÚ (Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 349).

Článok 4

Zaznamenávanie dátumu a času

1. Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o dátume a čase vzniku každej udalosti uvedenej v poli 21 tabuľky 2 prílohy k tomuto nariadeniu, a to s presnosťou stanovenou v článku 2 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2017/574 ⁽¹⁾, ako sa uvádza v poli 9 tabuľky 2 prílohy k tomuto nariadeniu. S výnimkou zaznamenávania dátumu a času odmietnutia pokynov systémami obchodného miesta sa všetky udalosti uvedené v poli 21 tabuľky 2 prílohy k tomuto nariadeniu zaznamenávajú pomocou obchodných hodín používaných párovacími zariadeniami obchodného miesta.
2. Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o dátume a čase každého prvku údajov uvedeného v poliach 49, 50 a 51 tabuľky 2 prílohy k tomuto nariadeniu, a to s presnosťou stanovenou v článku 2 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2017/574.

Článok 5

Doba platnosti a obmedzenia pokynu

1. Organizátori obchodných miest vedú záznamy o dobe platnosti a obmedzeniach pokynov, ktoré sú uvedené v poliach 10 a 11 tabuľky 2 prílohy.
2. Záznamy o dátumoch a časoch, pokiaľ ide o dobu platnosti, sa uchovávajú v súlade s polom 12 tabuľky 2 prílohy pre každú dobu platnosti.

Článok 6

Priorita a poradové čísla

1. Organizátori obchodných miest, ktorí prevádzkujú systémy obchodovania uplatňovaním priority určenej viditeľnosťou, cenou a časom, uchovávajú záznamy o prioritnej časovej pečiatke pre všetky pokyny, ako sa uvádza v poli 13 tabuľky 2 prílohy. Prioritná časová pečiatka sa zaznamenáva s rovnakým stupňom presnosti, ako sa stanovuje v článku 4 ods. 1.
2. Organizátori obchodných miest, ktorí prevádzkujú systémy obchodovania uplatňovaním priority určenej veľkosťou a časom, uchovávajú záznamy o objemoch, ktoré určujú prioritu pokynov, ako sa uvádza v poli 14 tabuľky 2 prílohy, ako aj o prioritnej časovej pečiatke uvedenej v odseku 1.
3. Organizátori obchodných miest, ktorí využívajú kombináciu priority určenej viditeľnosťou, cenou a časom a priority určenej veľkosťou a časom, pričom vo svojej knihe objednávok zobrazujú pokyny v závislosti od časovej priority, musia byť v súlade s odsekom 1.
4. Organizátori obchodných miest, ktorí využívajú kombináciu priority určenej viditeľnosťou, cenou a časom a priority určenej veľkosťou a časom, pričom vo svojej knihe objednávok zobrazujú pokyny v závislosti od priority určenej objemom a časom, musia byť v súlade s odsekom 2.
5. Organizátori obchodných miest pridelia každej udalosti poradové číslo a to následne zachovávajú, ako sa uvádza v poli 15 tabuľky 2 prílohy.

Článok 7

Identifikačné kódy pokynov súvisiacich s finančnými nástrojmi

1. Organizátori obchodných miest uchovávajú pre každý pokyn individuálny identifikačný kód, ako sa uvádza v poli 20 tabuľky 2 prílohy. Identifikačný kód musí byť vzhľadom na danú knihu objednávok, obchodný deň a finančný nástroj jedinečný. Uplatňuje sa od prijatia pokynu organizátorom obchodného miesta až do vyradenia pokynu z knihy objednávok. Identifikačný kód sa vzťahuje aj na odmietnuté pokyny bez ohľadu na dôvod ich odmietnutia.

⁽¹⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/574 zo 7. júna 2016, ktorým sa dopĺňa smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa úrovne presnosti obchodných hodín (pozri stranu 148 tohto úradného vestníka).

2. Organizátor obchodného miesta uchováva príslušné údaje o strategických pokynoch s implicitnou funkcionalitou (SOIF), ktoré sú šírené verejnosti tak, ako sa uvádza v prílohe. Pole 33 tabuľky 2 prílohy zahŕňa vyhlásenie, že pokyn je implicitným pokynom.

Po vykonaní pokynu SOIF údaje o ňom uchováva organizátor obchodného miesta, ako sa uvádza v prílohe.

Po vykonaní pokynu SOIF sa uvedie identifikačný kód pokynu viazaného na stratégiu, a to s použitím rovnakého identifikačného kódu pre všetky pokyny spojené s danou konkrétnou stratégiou. Identifikačný kód pokynu viazaného na stratégiu sa uvedie v súlade s poľom 46 tabuľky 2 prílohy.

3. Pokyny zadané obchodnému miestu umožňujúcemu stratégiu smerovania identifikuje dané obchodné miesto ako „smerované“ v súlade s poľom 33 tabuľky 2 prílohy, ak sú smerované na iné obchodné miesto. Pokyny zadané obchodnému miestu umožňujúcemu stratégiu smerovania si zachovávajú rovnaký identifikačný kód počas celej svojej existencie bez ohľadu na to, či sa akékoľvek zostávajúce množstvo opätovne zaúčtuje vo vstupnej knihe objednávok.

Článok 8

Udalosti ovplyvňujúce pokyny súvisiace s finančnými nástrojmi

Organizátori obchodných miest uchovávajú v súvislosti s novými pokynmi záznamy o údajoch uvedených v poli 21 tabuľky 2 prílohy.

Článok 9

Typy pokynov súvisiacich s finančnými nástrojmi

1. Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o type pokynov v súvislosti s každým prijatým pokynom, a to na základe svojej vlastnej klasifikácie, ako sa uvádza v poli 22 tabuľky 2 prílohy.

2. Organizátori obchodných miest klasifikujú každý prijatý pokyn buď ako limitný pokyn alebo ako stop pokyn, ako sa uvádza v poli 23 tabuľky 2 prílohy.

Článok 10

Ceny týkajúce sa pokynov

Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o všetkých údajoch súvisiacich s cenou, ako sa uvádza v oddiele I tabuľky 2 prílohy, pokiaľ sa k týmto pokynom vzťahujú.

Článok 11

Inštrukcie súvisiace s pokynmi

Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o všetkých prijatých inštrukciách súvisiacich s pokynmi, ako sa uvádza v oddiele J tabuľky 2 prílohy.

Článok 12

Identifikačný kód transakcie pridelený obchodným miestom

Organizátori obchodných miest uchovávajú individuálny identifikačný kód transakcie v prípade každej transakcie vyplývajúcej z úplného alebo čiastočného vykonania pokynu, ako sa uvádza v poli 48 tabuľky 2 prílohy.

*Článok 13***Fázy obchodovania a indikatívna aukčná cena a objem**

1. Organizátori obchodných miest uchovávajú záznamy o údajoch o pokyne, ako sa uvádza v oddiele K tabuľky 2 prílohy.
2. Ak príslušné orgány požadujú údaje uvedené v oddiele K podľa článku 1, údaje uvedené v poliach 9 a 15 až 18 tabuľky 2 prílohy sa tiež považujú za údaje, ktoré sa vzťahujú k pokynu dotknutému touto žiadosťou.

*Článok 14***Nadobudnutie účinnosti a uplatňovanie**

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom nasledujúcim po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Uplatňuje sa od dátumu uvedeného v druhom odseku článku 55 nariadenia (EÚ) č. 600/2014.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 24. júna 2016

Za Komisiu

predseda

Jean-Claude JUNCKER

PRÍLOHA

Tabuľka 1

Vysvetlivky k tabuľke 2

SYMBOL	DRUH ÚDAJOV	VYMEDZENIE POJMU
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znakov	Pole s voľným textom.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	3-miestny kód meny podľa ISO 4217 pre kódy mien
{DATE_TIME_FORMAT}	Formát dátumu a času podľa ISO 8601	Dátum a čas v tomto formáte: RRRR-MM-DDThh:mm:s.ddddddZ. — „RRRR“ je rok; — „MM“ je mesiac; — „DD“ je deň; — „T“ – znamená, že sa použije písmeno „T“ — „hh“ je hodina; — „mm“ je minúta; — „s.dddddd“ je sekunda a jej zlomok; — Z je čas UTC. Dátumy a časy sa uvádzajú v UTC.
{DATEFORMAT}	Formát dátumu podľa ISO 8601	Dátumy sa uvádzajú v tomto formáte: RRRR-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Desatinné číslo v celkovom rozsahu až n číslic, z toho až m číslic môžu tvoriť zlomky;	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty. — oddeľovač desatinných miest je „.“ (bodka), — pred zápornými číslami sa uvádza znamienko „-“ (mínus), — hodnoty sú zaokrúhlené a neskrátené.
{INTEGER-n}	Celé číslo v celkovom rozsahu až n číslic	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty celých čísiel.
{ISIN}	12 alfanumerických znakov	Kód ISIN podľa ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerických znakov	Identifikátor právnickej osoby, ako sa vymedzuje v ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikátor trhu, ako sa vymedzuje v ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alfanumerických znakov	Identifikátor je stanovený v článku 6 a prílohe II k delegovanému nariadeniu Komisie (EÚ) 2017/590 ⁽¹⁾ .

⁽¹⁾ Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/590 z 28. júla 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa oznamovania transakcií príslušným orgánom (pozri stranu 449 tohto úradného vestníka).

Tabuľka 2

Podrobnosti pokynov

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
----	------	---	---

Oddiel A – Identifikácia relevantných strán

1	Identifikácia subjektu, ktorý zadal pokyn	Totožnosť člena alebo účastníka miesta obchodovania. V prípade priameho elektronického prístupu (DEA) ide o totožnosť jedného z poskytovateľov DEA.	{LEI}
2	Priamy elektronický prístup (DEA)	„true“ ak bol pokyn zadán obchodnému miestu za použitia DEA v zmysle článku 4 ods. 1 bodu 41 smernice 2014/65/EÚ. „false“ ak pokyn nebol zadán obchodnému miestu za použitia DEA v zmysle článku 4 ods. 1 bodu 41 smernice 2014/65/EÚ.	'true' 'false'
3	Identifikačný kód klienta	Kód používaný na identifikáciu klienta člena alebo účastníka obchodného miesta. V prípade, že existuje DEA, použije sa kód používateľa DEA. Ak je klientom právnická osoba, použije sa kód LEI klienta. Ak klientom nie je právnická osoba, použije sa {NATIONAL_ID}. V prípade súhrnných pokynov sa použije označenie AGGR, ako sa uvádza v článku 2 ods. 3 tohto nariadenia. V prípade čakajúcich alokácií sa použije označenie PNAL, ako sa uvádza v článku 2 ods. 2 tohto nariadenia. Toto pole sa ponechá prázdne, iba ak člen alebo účastník obchodného miesta nemá klienta.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR“ – súhrnné pokyny „PNAL“ – čakajúce alokácie
4	Investičné rozhodnutie v rámci spoločnosti	Kód používaný na identifikáciu tej osoby alebo algoritmu, ktorý v rámci člena alebo účastníka obchodného miesta zodpovedá za investičné rozhodnutie v súlade s článkom 8 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590. Ak sú za investičné rozhodnutie zodpovedné fyzické osoby v rámci člena alebo účastníka obchodného miesta, osoba, ktorá je zodpovedná alebo má primárnu zodpovednosť za investičné rozhodnutie, bude identifikovaná pomocou {NATIONAL_ID}. Ak bol za investičné rozhodnutie zodpovedný algoritmus, pole sa vyplní v súlade s článkom 8 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590. Toto pole sa ponechá prázdne v prípade, že investičné rozhodnutie nebolo vykonané osobou ani algoritmom v rámci člena alebo účastníka obchodného miesta.	{NATIONAL_ID} – fyzické osoby {ALPHANUM-50} – algoritmus
5	Vykonanie v rámci spoločnosti	Kód používaný na identifikáciu tej osoby alebo algoritmu, ktorý v rámci člena alebo účastníka obchodného miesta zodpovedá za vykonanie transakcie vyplývajúcej z pokynu v súlade s článkom 9 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590. Ak je za vykonanie transakcie zodpovedná fyzická osoba, táto osoba bude identifikovaná pomocou {NATIONAL_ID}.	{NATIONAL_ID} – fyzické osoby {ALPHANUM-50} – algoritmus

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		Ak je za vykonanie transakcie zodpovedný algoritmus, toto pole sa vyplní v súlade s článkom 9 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590. Ak je do vykonania transakcie zapojená viac ako jedna osoba alebo kombinácia osôb a algoritmov, člen alebo účastník alebo klient obchodného miesta stanoví obchodníka alebo algoritmus primárne zodpovedný podľa článku 9 ods. 4 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590 a v tomto poli uvedie identitu tohto obchodníka alebo algoritmu.	
6	Nevykonávajúci maklér	V súlade s článkom 2 písm. d). Toto pole sa ponechá prázdne, ak nie je relevantné.	{LEI}

Oddiel B – Obchodné postavenie a zabezpečovanie likvidity

7	Obchodné postavenie	Udáva, či je zadanie pokynu dôsledkom toho, že člen alebo účastník obchodného miesta vykonáva obchodovanie párovaním na vlastný účet podľa článku 4 ods. 38 smernice 2014/65/EÚ alebo obchodovanie na vlastný účet podľa článku 4 ods. 6 smernice 2014/65/EÚ. Ak zadanie pokynu nie je dôsledkom toho, že člen alebo účastník obchodného miesta vykonáva obchodovanie párovaním na vlastný účet alebo obchodovanie na vlastný účet, v tomto poli sa uvedie, že transakcia bola vykonaná v inom postavení.	„DEAL“ – obchodovanie na vlastný účet „MTCH“ – obchodovanie párovaním na vlastný účet „AOTC“ – iné postavenie
8	Činnosť zameraná na zabezpečovanie likvidity	Udáva, či bol pokyn zadán obchodnému miestu ako súčasť stratégie tvorby trhu podľa článkov 17 a 48 smernice 2014/65/EÚ, alebo bol zadán ako súčasť inej činnosti v súlade s článkom 3 tohto nariadenia.	'true' 'false'

Oddiel C – Dátum a čas

9	Dátum a čas	Dátum a čas každej udalosti uvedenej v oddiele [G] a [K].	{DATE_TIME_FORMAT} Počet číslic nasledujúcich za „sekundami“ sa určí v súlade s článkom 2 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/574.
---	-------------	---	--

Oddiel D – Doba platnosti a obmedzenia pokynov

10	Doba platnosti	Platný daný deň (Good-For-Day): platnosť pokynu uplynie na konci obchodného dňa, v ktorom bol zadán do knihy objednávok. Platný do zrušenia (Good-Till-Cancelled): pokyn ostáva aktívny v knihe objednávok a je vykonateľný, až kým nie je skutočne zrušený.	„DAVY“ – Good-For-Day (platný daný deň) „GTCV“ – Good-Till-Cancelled (platný do zrušenia)
----	----------------	--	---

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		Platný do času (Good-Till-Time): platnosť pokynu uplynie najneskôr vo vopred určenom čase v rámci aktuálneho intervalu obchodovania. Platný do dátumu (Good-Till-Date): platnosť pokynu uplynie na konci stanoveného kalendárneho dňa. Platný do stanoveného dátumu a času (Good-Till-Specified Date and Time): platnosť pokynu uplynie k stanovenému dátumu a času. Platný do času (Good-Till-Time): platnosť pokynu uplynie najneskôr vo vopred určenom čase v rámci aktuálneho intervalu obchodovania. Platný po dátume (Good After Date): pokyn je aktívny len od začiatku vopred určeného dátumu. Platný po stanovenom dátume a čase (Good After Specified Date and Time): pokyn je aktívny len od začiatku vopred určeného dátumu a času. Vykonať okamžite alebo zrušiť (Immediate-Or-Cancel): pokyn, ktorý sa vykoná po zadaní do knihy objednávok (v množstve, ktoré môže byť predmetom vykonania) a ktorého zostávajúca časť (ak nejaká je), ktorá sa nestala predmetom vykonania, neostáva v knihe objednávok. Splň alebo zruš (Fill-Or-Kill): pokyn, ktorý sa vykoná pri zadaní do knihy objednávok za predpokladu, že celý môže byť predmetom vykonania; ak pokyn možno vykonať len čiastočne, automaticky je odmietnutý a nemožno ho preto vykonať. Iné: akékoľvek doplnujúce údaje, ktoré sú špecifické pre konkrétne obchodné modely, obchodné platformy alebo systémy.	„GTTV“ – Good-Till-Time (platný do času) „GTDV“ – Good-Till-Date (platný do dátumu) „GTSV“ – Good-Till-Specified Date and Time (platný do stanoveného dátumu a času) „GATV“ – Good After Time (platný po čase) „GADV“ – Good After Date (platný po dátume) „GASV“ – Good-After-Specified Date and Time (platný po stanovenom dátume a čase) „IOCV“ – Immediate-Or-Cancel (vykonať okamžite alebo zrušiť) „FOKV“ – Fill-Or-Kill (splň alebo zruš) alebo {ALPHANUM-4} znakov, ktoré obchodné miesto ešte nepoužilo pre vlastnú klasifikáciu.
11	Obmedzenia pokynov	Platný pre interval obchodovania za záverečnú cenu (Good For Closing Price Crossing Session): ak sa pokyn kvalifikuje pre interval obchodovania za záverečnú cenu. Platný pre aukciu (Valid For Auction): pokyn je platný a môže byť vykonaný len vo fázach aukcie (ktoré môže vopred určiť člen alebo účastník obchodného miesta, ktorý pokyn zadal, napr. úvodná alebo záverečná aukcia alebo intra-denná aukcia). Platný len pre kontinuálne obchodovanie (Valid For Continuous Trading only): pokyn je aktívny len počas kontinuálneho obchodovania.	„SESR“ – Good For Closing Price Crossing Session (platný pre interval obchodovania za záverečnú cenu) „VFAR“ – Valid For Auction (platný pre aukciu) „VFCR“ – Valid For Continuous Trading only (platný len pre kontinuálne obchodovanie)

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		Iné: akékoľvek doplňujúce údaje, ktoré sú špecifické pre konkrétne obchodné modely, obchodné platformy alebo systémy.	{ALPHANUM-4} znakov, ktoré obchodné miesto ešte nepoužilo pre vlastnú klasifikáciu. Ak sú uplatniteľné viaceré typy, toto pole sa vyplní viacerými označeniami oddelenými čiarkou.
12	Doba a čas platnosti	Tieto údaje sa týkajú časovej pečiatky odzrkadľujúcej čas, keď sa pokyn stal aktívnym alebo keď sa úplne odstránil z knihy objednávok. Platný daný deň (Good for day): dátum zadania s časovou pečiatkou bezprostredne pred polnocou. Platný do času (Good till time): dátum zadania a doba do času stanoveného v pokyne. Platný do dátumu (Good till day): stanovený dátum uplynutia platnosti s časovou pečiatkou bezprostredne pred polnocou. Platný do stanoveného dátumu a času (Good till specified date and time): stanovený dátum a čas uplynutia platnosti. Platný po čase (Good after time): dátum zadania a stanovený čas, keď sa pokyn stane aktívnym. Platný po dátume (Good after date): stanovený dátum s časovou pečiatkou bezprostredne po polnoci. Platný po stanovenom dátume a čase (Good after specified date and time): stanovený dátum a čas, keď sa pokyn stane aktívnym. Platný do zrušenia (Good till Cancel): konečný dátum a čas, keď sa pokyn odstráni v dôsledku trhových operácií. Iné: časová pečiatka pre akýkoľvek iný druh platnosti.	{DATE_TIME_FORMAT} Počet číslic nasledujúcich za „sekundami“ sa určí v súlade s článkom 2 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/574.

Oddiel E – Priorita a poradové číslo

13	Prioritná časová pečiatka	Toto pole sa aktualizuje vždy, keď sa priorita pokynu zmení.	{DATE_TIME_FORMAT} Počet číslic nasledujúcich za „sekundami“ sa určí v súlade s článkom 2 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/574.
14	Prioritná veľkosť	V prípade obchodných miest, ktoré používajú prioritu určenú veľkosťou a časom, sa v tomto poli uvedie kladné číslo zodpovedajúce množstvu. Toto pole sa aktualizuje vždy, keď sa priorita pokynu zmení.	Najviac 20 kladných číslic.
15	Poradové číslo	Každá jednotlivá udalosť uvedená v oddiele G sa identifikuje pomocou kladných celých čísel vo vzostupnom poradí. Toto poradové číslo je jedinečné pre každý typ udalosti, je konzistentné naprieč všetkými udalosťami, ktoré organizátor obchodného miesta označil časovou pečiatkou, a zachováva sa počas dňa, v ktorom udalosť nastala.	{INTEGER-50}

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
----	------	---	---

Oddiel F – Identifikácia pokynu

16	Kód MIC segmentu	Identifikácia obchodného miesta, na ktorom bol pokyn zadán. Ak obchodné miesto používa segmentové MIC, potom sa použije segmentový MIC. Ak obchodné miesto nepoužíva segmentové MIC, potom sa použije hlavný MIC.	{MIC}
17	Kód knihy objednávok	Alfanumerický kód stanovený obchodným miestom pre každú jednotlivú knihu objednávok.	{ALPHANUM-20}
18	Identifikačný kód finančného nástroja	Jedinečný a jednoznačný identifikátor finančného nástroja	{ISIN}
19	Dátum prijatia	Dátum prijatia pôvodného pokynu.	{DATEFORMAT}
20	Identifikačný kód pokynu	Alfanumerický kód, ktorý pridelil organizátor obchodného miesta jednotlivému pokynu.	{ALPHANUM-50}

Oddiel G – Udalosti ovplyvňujúce pokyn

21	Nový pokyn, zmena pokynu, zrušenie pokynu, odmietnutie pokynu, úplné alebo čiastočné vykonanie	Nový pokyn: prijatie nového pokynu organizátorom obchodného miesta. Aktivovaný: pokyn, ktorý sa stane vykonateľným alebo prípadne nevykonateľným na základe splnenia vopred stanovenej podmienky. Nahradený členom alebo účastníkom obchodného miesta: ak sa člen, účastník alebo klient obchodného miesta rozhodne z vlastnej iniciatívy zmeniť akúkoľvek charakteristiku pokynu, ktorý predtým zadal do knihy objednávok. Nahradený trhovými operáciami (automaticky): ak akúkoľvek charakteristiku pokynu zmenia počítačové systémy organizátora obchodného miesta. Zahŕňa to situáciu, keď sa charakteristika viazaného (<i>peg</i>) pokynu alebo pohyblivého (<i>trailing</i>) stop pokynu zmení s cieľom zohľadniť pozíciu pokynu v knihe objednávok. Nahradený trhovými operáciami (ľudský zásah): ak akúkoľvek charakteristiku pokynu zmenia zamestnanci organizátora obchodného miesta. Zahŕňa to situáciu, keď člen alebo účastník obchodného miesta má problémy s výpočtovou technikou a potrebuje, aby sa jeho pokyny urýchlili zrušili. Zmena stavu z iniciatívy člena alebo účastníka obchodného miesta. Zahŕňa aktiváciu a deaktiváciu.	„NEWO“ – New order (nový pokyn) ‘TRIG’ – Triggered (aktivovaný) ‘REME’ – Replaced by the member or participant of the trading venue (nahradený členom alebo účastníkom obchodného miesta) ‘REMA’ – Replaced by market operations (automatic) (nahradený trhovými operáciami (automaticky)) ‘REMH’ – Replaced by market operations (human intervention) (nahradený trhovými operáciami (ľudský zásah)) ‘CHME’ – Change of status at the initiative of the member or participant of the trading venue (zmena stavu z iniciatívy člena alebo účastníka obchodného miesta)
----	--	--	--

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		Zmena stavu v dôsledku trhových operácií. Zrušený z iniciatívy člena alebo účastníka obchodného miesta; ak sa člen, účastník alebo klient rozhodne z vlastnej iniciatívy zrušiť pokyn, ktorý predtým zadal. Zrušený trhovými operáciami. Zahŕňa to ochranný mechanizmus ustanovený pre investičné spoločnosti vykonávajúce činnosti tvorby trhu, ako sa stanovuje v článkoch 17 a 48 smernice 2014/65/EÚ. Odmietnutý pokyn: pokyn, ktorý organizátor obchodného miesta prijal ale odmietol. Pokyn s uplynulou platnosťou: ak sa pokyn odstráni z knihy objednávok na konci jeho doby platnosti. Čiastočne vykonaný: ak pokyn nie je vykonaný úplne a určité množstvo zostáva na vykonanie. Vykonaný: ak na vykonanie už nezostáva žiadne množstvo.	'CHMO' – Change of status due to market operations (zmena stavu v dôsledku trhových operácií) 'CAME' – Cancelled at the initiative of the member or participant of the trading venue (zrušený z iniciatívy člena alebo účastníka obchodného miesta) 'CAMO' – Cancelled by market operations (zrušený trhovými operáciami) 'REMO' – Rejected order (odmietnutý pokyn) 'EXPI' – Expired order (pokyn s uplynulou platnosťou) 'PARF' – Partially filled (čiastočne vykonaný) 'FILL' – Filled (vykonaný) {ALPHANUM-4} znakov, ktoré obchodné miesto ešte nepoužilo pre vlastnú klasifikáciu.

Oddiel H – Typ pokynu

22	Typ pokynu	Identifikuje typ pokynu zadaného obchodnému miestu podľa špecifikácie obchodného miesta.	{ALPHANUM-50}
23	Klasifikácia typov pokynov	Klasifikácia pokynov podľa dvoch generických typov pokynov. LIMITNÝ pokyn: v prípadoch, keď je pokyn obchodovateľný, a STOP pokyn: v prípadoch, keď sa pokyn stáva obchodovateľným len vtedy, ak nastane vopred určená cenová udalosť.	Pre limitný pokyn sa použije skratka „LMTO“ a pre stop pokyn výraz „STOP“.

Oddiel I – Ceny

24	Limitná cena	Maximálna cena, za ktorú sa pokyn na kúpu môže obchodovať alebo minimálna cena, za ktorú sa môže pokyn na kúpu obchodovať. Cenové rozpätie pre strategický pokyn. Môže byť negatívne alebo pozitívne.	{DECIMAL-18/13} v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke.
----	--------------	---	---

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		Toto pole sa ponechá prázdne v prípade pokynov, ktoré nemajú limitnú cenu, alebo v prípade pokynov bez ceny. V prípade konvertibilných dlhopisov sa v tomto poli uvedie skutočná cena (čistá – <i>clean</i> alebo hrubá – <i>dirty</i>) použitá pre tento pokyn.	{DECIMAL-11/10} v prípade ceny vyjadrenej ako percentuálna hodnota alebo výnos. {DECIMAL-18/17} v prípade ceny vyjadrenej v bázičných bodoch.
25	Dodatočná limitná cena	Akákoľvek iná limitná cena, ktorá sa môže týkať pokynu. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{DECIMAL-18/13} v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke. {DECIMAL-11/10} v prípade ceny vyjadrenej ako percentuálna hodnota alebo výnos. {DECIMAL-18/17} v prípade ceny vyjadrenej v bázičných bodoch.
26	Stop cena	Cena, ktorá sa musí dosiahnuť na to, aby sa pokyn stali aktívnym. V prípade stop pokynov aktivovaných udalosťami nezávislými od ceny finančného nástroja sa v tomto poli uvedie stop cena rovná nule. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{DECIMAL-18/13} v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke. {DECIMAL-11/10} v prípade ceny vyjadrenej ako percentuálna hodnota alebo výnos. {DECIMAL-18/17} v prípade ceny vyjadrenej v bázičných bodoch.
27	Viazaná (<i>pegged</i>) limitná cena	Maximálna cena, za ktorú sa môže obchodovať viazaný pokyn na kúpu alebo minimálna cena, za ktorú sa môže obchodovať viazaný pokyn na predaj. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{DECIMAL-18/13} v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke. {DECIMAL-11/10} v prípade ceny vyjadrenej ako percentuálna hodnota alebo výnos. {DECIMAL-18/17} v prípade ceny vyjadrenej v bázičných bodoch.

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
28	Transakčná cena	Obchodná cena transakcie nezahŕňajúca, ak je to relevantné, províziu a vzniknutý úrok. V prípade opčných kontraktov predstavuje prémie derivátového kontraktu pripadajúcu na podkladové aktívum alebo indexový bod. V prípade stávok na rozpätie (<i>spread bets</i>) predstavuje referenčnú cenu priameho podkladového nástroja. V prípade swapov na kreditné zlyhanie (CDS) predstavuje kupón v bázičných bodoch. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke. Ak cenu nemožno použiť, v tomto poli sa uvedie „NOAP“.	{DECIMAL-18/13} v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota. {DECIMAL-11/10} v prípade ceny vyjadrenej ako percentuálna hodnota alebo výnos. {DECIMAL-18/17} v prípade ceny vyjadrenej v bázičných bodoch. „NOAP“
29	Mena, v ktorej je vyjadrená cena	Mena, v ktorej je vyjadrená obchodná cena pri finančnom nástroji týkajúcom sa daného pokynu (uplatniteľné v prípade ceny vyjadrenej ako peňažná hodnota).	{CURRENCYCODE_3}
30	Mena 2. nohy	V prípade multimenových alebo krížových menových swapov je mena 2. nohy mena, v ktorej je denominovaná 2. noha kontraktu. V prípade swapcií, ktorých podkladový swap je multimenový, je mena 2. nohy mena, v ktorej je denominovaná 2. noha swapu. Toto pole sa vyplní len v prípade úrokových a menových derivátových kontraktov.	{CURRENCYCODE_3}
31	Vyjadrenie ceny	Udáva, či je cena vyjadrená v peňažnej hodnote, v percentuálnej hodnote, vo výnosoch alebo v bázičných bodoch.	„MONE“ – Monetary value (menová hodnota) „PERC“ – Percentage (percentuálna hodnota) „YIEL“ – Yield (výnos) „BAPO“ – Basis points (bázičné body)

Oddiel J – Inštrukcie súvisiace s pokynmi

32	Ukazovateľ kúpa-predaj	Vyjadruje, či ide o pokyn na kúpu alebo predaj. V prípade opcií a swapcií je kupujúcim protistrana, ktorá má právo uplatniť opciu, a predávajúcim je protistrana, ktorá opciu predáva a dostáva prémie. V prípade iných futures a forwardov, než sú futures a forwardy týkajúce sa mien, je kupujúcim protistrana kupujúca nástroj a predávajúcim je protistrana predávajúca nástroj. V prípade swapov týkajúcich sa cenných papierov je kupujúcim protistrana, ktorá preberá riziko pohybu ceny podkladového cenného papiera a dostáva sumu zaistenia. Predávajúcim je protistrana, ktorá zaplatí sumu zaistenia.	„BUYI“ – buy (kúpa) „SELL“ – sell (predaj)
----	------------------------	--	--

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
		V prípade swapov týkajúcich sa úrokových sadzieb alebo indexov inflácie je kupujúcim protistrana, ktorá zaplatí pevnú úrokovú sadzbu. Predávajúcim je protistrana, ktorá prijíma pevnú úrokovú sadzbu. V prípade bazických swapov (float-to-float úrokových swapov) je kupujúcim protistrana, ktorá zaplatí rozpätie (spread), a predávajúcim protistrana, ktorá rozpätie prijíma. V prípade swapov a forwardov týkajúcich sa mien a krížových menových swapov je kupujúcim protistrana prijímajúca menu, ktorá je pri abecednom zoradení podľa normy ISO 4217 prvá, a predávajúcim je protistrana, ktorá túto menu dodáva. V prípade swapov týkajúcich sa dividend je kupujúcim protistrana prijímajúca ekvivalentnú platbu skutočných dividend. Predávajúcim je protistrana vyplácajúca dividendy a prijímajúca pevnú úrokovú sadzbu. V prípade derivátových nástrojov na prenos kreditného rizika, okrem opcií a swapcií, je kupujúcim protistrana kupujúca ochranu. Predávajúcim je protistrana predávajúca ochranu. V prípade derivátových kontraktov týkajúcich sa komodít alebo emisných kvót je kupujúcim protistrana, ktorá prijíma komoditu alebo emisnú kvótu uvedenú v správe, a predávajúcim je protistrana dodávajúca túto komoditu alebo emisnú kvótu. V prípade dohôd o budúcich úrokových sadzbách je kupujúcim protistrana, ktorá platí pevnú úrokovú sadzbu a predávajúcim je protistrana prijímajúca pevnú úrokovú sadzbu. V prípade zvýšenia nominálnej hodnoty je kupujúcim rovnaký subjekt ako nadobúdateľ (<i>acquirer</i>) finančného nástroja v pôvodnej transakcii a predávajúcim je rovnaký subjekt ako scudziteľ (<i>disposer</i>) finančného nástroja v pôvodnej transakcii. V prípade zvýšenia nominálnej hodnoty je kupujúcim rovnaký subjekt ako scudziteľ (<i>disposer</i>) finančného nástroja v pôvodnej transakcii a predávajúcim je rovnaký subjekt ako nadobúdateľ (<i>acquirer</i>) finančného nástroja v pôvodnej transakcii.	
33	Stav pokynu	Identifikácia pokynov, ktoré sú aktívne/neaktívne/pozastavené, pevné/indikatívne (priradené len kotáciám)/implicitné/presmerované. Aktívne – nekótované pokyny, ktoré sú obchodovateľné. Neaktívne – nekótované pokyny, ktoré nie sú obchodovateľné. Pevné/indikatívne – priradené len kotáciám. Ak sú kotácie indikatívne, znamená to, že sú viditeľné, ale nie je ich možné vykonať. Zahŕňa to warranty na niektorých obchodných miestach. Pevné kotácie možno vykonať. Implicitné – používané pri strategických pokynoch, ktoré sú odvodené od „implied in“ alebo „implied out“ funkcionality. Smerované – používané pri pokynoch, ktoré obchodné miesto smeruje na iné miesta.	‘ACTI’– active (aktívne) alebo ‘INAC’– inactive (neaktívne) alebo ‘FIRM’– firm quotes (pevné kotácie) alebo ‘INDI’– indicative quotes (indikatívne) alebo ‘IMPL’– implied strategy orders (pokyny s implicitnou stratégiou) alebo ‘ROUT’– routed orders (smerované pokyny). Ak sú uplatniteľné viaceré stavy, toto pole sa vyplní viacerými označeniami oddelenými čiarkou.

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
34	Uvedenie množstva	Udáva, či sa oznámené množstvo vyjadruje v počte kusov, ako nominálna hodnota alebo ako peňažná hodnota.	'UNIT' – Number of units (počet jednotiek) 'NOML' – Nominal value (nominálna hodnota) „MONE“ – Monetary value (peňažná hodnota)
35	Mena, v ktorej je množstvo vyjadrené	Mena, v ktorej je množstvo vyjadrené. Toto pole sa vyplní, len ak je množstvo vyjadrené ako nominálna alebo peňažná hodnota.	{CURRENCYCODE_3}
36	Pôvodné množstvo	Počet jednotiek finančného nástroja alebo počet derivátových kontraktov v pokyne. Nominálna alebo peňažná hodnota finančného nástroja. V prípade stávk na rozpätie (<i>spread bets</i>) sa množstvo uvedie ako peňažná hodnota stavená na bod cenovej zmeny podkladového finančného nástroja. V prípade zvýšenia alebo zníženia nominálnej hodnoty podkladového aktíva pri derivátových kontraktoch množstvo odzrkadľuje absolútnu hodnotu zmeny a je vyjadrené ako kladné číslo. V prípade swapov na kreditné zlyhanie je množstvom nominálna hodnota, pre ktorú sa ochrana nadobúda alebo scudzuje.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek. {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote
37	Zostávajúce množstvo vrátane skrytého	Celkové množstvo, ktoré zostáva v knihe objednávok po čiastočnom vykonaní alebo v prípade akejkoľvek inej udalosti ovplyvňujúcej pokyn. V prípade udalosti, ktorá znamená čiastočné vykonanie pokynu, ide o zostávajúci objem po tomto čiastočnom vykonaní. Pri zadaní pokynu ide o množstvo rovnajúce sa počiatočnému množstvu.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote
38	Zobrazené množstvo	Množstvo, ktoré je viditeľné (v protiklade k skrytému) v knihe objednávok.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote
39	Obchodované množstvo	V prípade čiastočného alebo úplného vykonania sa v tomto poli uvedie vykonané množstvo.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote
40	Minimálne akceptovateľné množstvo (Minimum Acceptable Quantity – MAQ)	Minimálne akceptovateľné množstvo v prípade pokynu, ktorý sa má vykonať, ktoré môže pozostávať z viacerých čiastočných vykonaní pokynov a týka sa zvyčajne len pokynov, ktoré ďalej nepretrvávajú. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
41	Minimálna vykonateľná veľkosť (Minimum executable size – MES)	Minimálna vykonateľná veľkosť akéhokoľvek jednotlivého potenciálneho vykonania. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{DECIMAL-18/17} v prípade množstva vyjadreného ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade množstva vyjadreného v peňažnej alebo nominálnej hodnote
42	Len prvé vykonanie MES	Udáva, či je MES relevantný len pre prvé vykonanie. Toto pole možno ponechať prázdne, ak sa ponechá prázdne pole 41.	'true' 'false'
43	Ukazovateľ „len pasívny“	Udáva, či sa pokyn zadal miestu obchodovania s takou charakteristikou/označením, aby sa okamžite nevykonával voči akýmkoľvek viditeľným protipokynom.	'true' 'false'
44	Ukazovateľ „pasívny alebo agresívny“	V prípade udalostí, ktoré znamenajú čiastočné vykonanie alebo vykonanie pokynu, udáva, či pokyn čakal v knihe objednávok a poskytoval likviditu (pasívny) alebo či sa pokynom inicioval obchod a pokyn takto nadobudol likviditu (agresívny). Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	„PASV“ – passive (pasívny) alebo „AGRE“ – aggressive (agresívny).
45	Zabránenie samovykonaniu	Udáva, či bol pokyn zadaný s kritériami zabráňujúcimi samovykonaniu, aby nebol vykonaný s pokynom na opačnej strane knihy zadaným tým istým členom alebo účastníkom.	'true' 'false'
46	Identifikácia pokynu prepojeného so stratégiou	Alfanumerický kód používaný na prepojenie všetkých súvisiacich pokynov, ktoré sú súčasťou stratégie podľa článku 7 ods. 2	{ALPHANUM-50}
47	Stratégia smerovania	Príslušná stratégia smerovania podľa špecifikácie obchodného miesta. Ak toto pole nie je relevantné, ponechá sa prázdne.	{ALPHANUM-50}
48	Identifikačný kód transakcie pridelený obchodným miestom	Alfanumerický kód pridelený obchodným miestom transakcii podľa článku 12 tohto nariadenia. Identifikačný kód transakcie pridelený obchodným miestom musí byť jedinečný, konzistentný a pretrvávajúci pre segmentový MIC podľa ISO 10383 a obchodný deň. Ak obchodné miesto nepoužíva segmentové MIC, identifikačný kód transakcie pridelený obchodným miestom musí byť jedinečný, konzistentný a pretrvávajúci pre hlavný MIC a obchodný deň. Zložky identifikačného kódu transakcie neodhaľujú identitu protistrán transakcie, v súvislosti s ktorou sa kód uchováva.	{ALPHANUM-52}

N.	Pole	Údaje o pokyne, ktoré sa majú uchovávať, aby boli k dispozícii príslušnému orgánu	Štandardy a formáty údajov o pokyne, ktoré sa majú použiť pri poskytovaní relevantných údajov o pokyne príslušnému orgánu na požiadanie
----	------	---	---

Oddiel K – Fázy obchodovania, orientačná aukčná cena a objem

49	Fázy obchodovania	Názov jednotlivých fáz obchodovania, počas ktorých sa pokyn nachádza v knihe objednávok, vrátane zastavenia, prerušenia a pozastavenia.	{ALPHANUM-50}
50	Orientačná aukčná cena	Cena, za ktorú má prebehnúť každá aukcia týkajúca sa finančného nástroja, pre ktorý bol zadán jeden alebo viac pokynov.	{DECIMAL-18/5} v prípade, že cena je vyjadrená v peňažnej alebo nominálnej hodnote Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvedie sa v hlavnej menovej jednotke. {DECIMAL-11/10} v prípade, že je cena vyjadrená ako percentuálna hodnota alebo výnos.
51	Orientačný aukčný objem	Objem (počet jednotiek finančného nástroja), ktorý možno vykonať za orientačnú aukčnú cenu uvedenú v poli 50, ak sa aukcia skončila presne v danom okamihu.	{DECIMAL-18/17} v prípade, že množstvo je vyjadrené ako počet jednotiek {DECIMAL-18/5} v prípade, že množstvo je vyjadrené v peňažnej alebo nominálnej hodnote