

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/580

av den 24 juni 2016

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller bevarande av relevanta uppgifter om order som avser finansiella instrument

(Text av betydelse för EES)

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artikel 25.3 fjärde stycket, och

av följande skäl:

- (1) Operatörer av handlingsplatser bör fritt kunna besluta om det sätt på vilket de ska föra register över relevanta uppgifter om samtliga order som avser finansiella instrument. För att möjliggöra en effektiv och ändamålsenlig sammanställning, jämförelse och analys av relevanta orderuppgifter i syfte att övervaka marknaden bör sådan information dock göras tillgänglig för de behöriga myndigheterna med hjälp av enhetliga standarder och format om en behörig myndighet begär sådan information i enlighet med artikel 25.2 i förordning (EU) nr 600/2014.
- (2) För att säkerställa tydlighet och rättssäkerhet och undvika dubbel lagring av samma information bör denna förordning omfatta alla uppgifter avseende order, inbegripet detaljerade uppgifter som ska rapporteras i enlighet med artiklarna 26.1 och 26.3.
- (3) I syfte att upptäcka och utreda potentiellt marknadsmissbruk eller försök till marknadsmissbruk på ett effektivt sätt måste behöriga myndigheter omgående kunna identifiera personer och enheter som kan vara delaktiga på ett påtagligt sätt i orderförfarandet, inbegripet medlemmar eller deltagare på handelsplatser, enheter som är ansvariga för beslut om investering och genomförande, icke-verkställande mäklare och kunder för vars räkning order initieras. Följaktligen bör operatörer av handelsplatser upprätthålla beteckningar för sådana parter.
- (4) För att behöriga myndigheter mer effektivt ska kunna identifiera misstänkt potentiellt missbruk som härrör från en kund, inbegripet när kunden verkar genom ett antal olika värdepappersföretag, bör operatörer av handelsplatser registrera identiteten hos de kunder för vars räkning deras medlemmar eller deltagare överfört ordern. Operatörer bör identifiera dessa kunder med hjälp av unika identifieringskoder för att möjliggöra en säker och effektiv identifiering av sådana personer och därigenom underlätta en mer effektiv analys av potentiellt marknadsmissbruk som kunder kan vara inblandade i.
- (5) Operatörer av handelsplatser bör inte vara skyldiga att registrera identifieringskoder för alla kunder i handelskedjan utan endast för den kund för vars räkning medlemmen eller deltagaren överfört ordern.
- (6) Identifiering av marknadsgarantstrategier eller liknande verksamhet är viktig för att kunna spåra marknadsmanipulation på ett effektivt sätt. Detta gör det möjligt för de behöriga myndigheterna att särskilja orderflödet från ett värdepappersföretag som agerar på grundval av villkor som förutbestämts av emittenten av det instrument som är föremål för ordern eller av den handelsplats till vilken ordern överförs, från orderflödet från ett värdepappersföretag som agerar på eget initiativ eller enligt sin kunds gottfinnande.
- (7) Ett register över exakt datum och tidpunkt samt över eventuella uppgifter om att en order har lagts, ändrats, annullerats, avvisats och genomförts bör upprätthållas. Detta gör det möjligt att övervaka ändringar av ordern under hela dess livstid, vilket kan vara avgörande för att spåra och bedöma potentiell marknadsmanipulation och front running (handel före kunden).

⁽¹⁾ EUTL 173, 12.6.2014, s. 84.

- (8) För att säkerställa en korrekt och komplett bild av en handelsplats orderbok behöver behöriga myndigheter information om handelssessioner i vilka finansiella instrument handlas. Denna information kan framför allt användas för att fastställa när auktionsperioder eller kontinuerlig handel börjar och slutar och huruvida order orsakar oplanerade handelsspärrar. Denna information behövs också för att identifiera hur order kommer att interagera, i synnerhet när sessioner slutar slumpmässigt som t.ex. auktioner. Information om preliminära jämviktspriser och -volymen efter fördelning (uncrossing) kommer också att göra det lättare att analysera potentiell auktionsmanipulation. Med tanke på att en enda order kan inverka antingen på auktionens jämviktspris och jämviktsvolym efter fördelning, eller på båda, måste behöriga myndigheter kunna se varje orders inverkan på dessa värden. Utan denna information skulle det vara svårt att identifiera vilken order som har haft inverkan på dessa värden. Dessutom bör ett ordningsnummer tilldelas varje relevant händelse i syfte att fastställa händelseförloppet när två eller flera händelser inträffar samtidigt.
- (9) Specificering av ordernas position i en orderbok möjliggör en rekonstruktion av orderboken och en analys av den ordningsföljd i vilken ordena har genomförts, vilket är en viktig del i övervakningen av marknadsmissbruk. Den position som tilldelas en order beror på hur prioriteringsordningen har fastställts av handelssystemet. Därför bör operatörer av handelsplatser tilldela och bevara uppgifter om ordernas prioritet i enlighet med prioriteringsmetoden pris-synlighet-tid eller prioriteringsmetoden storlek-tid.
- (10) För att kunna uppnå en effektiv marknadsövervakning måste det vara möjligt att koppla order till deras motsvarande transaktioner. Följaktligen bör operatörer av handelsplatser upprätthålla särskilda identifieringskoder för transaktioner som kopplar order till transaktioner.
- (11) Operatörer av handelsplatser bör för varje mottagen order registrera och bevara ordertypen och tillhörande specifika instruktioner som tillsammans avgör hur varje order ska hanteras av deras matchningsmotor, i enlighet med deras egen klassificering. Denna detaljerade information är avgörande för att behöriga myndigheter, som en del i deras övervakning av marknadsmissbruk, ska kunna övervaka handelsverksamhet i en viss handelsplats orderbok och framför allt kunna reproducera varje orders beteende inom orderboken. Med hänsyn till de många befintliga och potentiella nya ordertyper som utformats av operatörer av handelsplatser och de specifika tekniska detaljer som följer med dessa kan bevarandet av denna detaljerade information i enlighet med operatörernas interna klassificeringssystem dock för närvarande göra det svårt för behöriga myndigheter att reproducera orderboksaktiviteten hos alla handelsplatser på ett konsekvent sätt. För att behöriga myndigheter ska kunna vara i stånd att lokalisera varje order på ett exakt sätt inom orderboken bör operatörer av handelsplatser därför även klassificera varje mottagen order antingen som en limiterad order om ordern är omsättningsbar eller som en stopporder om ordern blir omsättningsbar endast efter det att en förutbestämd prishändelse inträffat.
- (12) Av konsekvensskäl och för att säkerställa välfungerande finansiella marknader är det nödvändigt att bestämmelserna i denna förordning och bestämmelserna i förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas från samma datum.
- (13) Denna förordning grundas på de förslag till tekniska standarder för tillsyn som Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) har lagt fram för kommissionen.
- (14) Esma har genomfört öppna offentliga samråd om de förslag till tekniska standarder för tillsyn som denna förordning baseras på. Esma har även analyserat möjliga relaterade kostnader och fördelar samt begärt in ett yttrande av den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010⁽¹⁾.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Tillämpningsområde, standarder och format för relevanta orderuppgifter

1. Operatörer av handelsplatser ska hålla uppgifter enligt artiklarna 2–13 om varje order som visas genom deras system enligt vad som anges i andra och tredje kolumnen i tabell 2 i bilagan, tillgängliga för sin behöriga myndighet i den mån de gäller den berörda ordern.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Om behöriga myndigheter begär någon av de uppgifter som avses i punkt 1 i enlighet med artikel 25.2 i förordning (EU) nr 600/2014 ska operatörer av handelsplatser tillhandahålla sådana uppgifter med hjälp av de standarder och format som föreskrivs i den fjärde kolumnen i tabell 2 i bilagan till denna förordning.

Artikel 2

Identifiering av de relevanta parterna

1. För samtliga order ska operatörer av handelsplatser föra register över följande uppgifter:
 - a) Den medlem eller deltagare på handelsplatsen som överförde ordern till handelsplatsen, identifierad i enlighet med uppgifterna i fält 1 i tabell 2 i bilagan.
 - b) Den person eller datoralgoritm inom medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen till vilken en order har överförts och som är ansvarig för investeringsbeslutet avseende ordern, identifierad i enlighet med uppgifterna i fält 4 i tabell 2 i bilagan.
 - c) Den person eller datoralgoritm inom medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen som är ansvarig för genomförandet av ordern, identifierad i enlighet med uppgifterna i fält 5 i tabell 2 i bilagan.
 - d) Den medlem eller deltagare på handelsplatsen som dirigerade ordern för en annan medlems eller aktörs räkning och i dennes namn, identifierad som en icke-verkställande mäklare såsom anges i fält 6 i tabell 2 i bilagan.
 - e) Den kund för vars räkning medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen överförde ordern till handelsplatsen, identifierad i enlighet med uppgifterna i fält 3 i tabell 2 i bilagan.
2. Om en medlem eller deltagare på handelsplatsen eller en kund till den handelsplatsen har tillstånd enligt en medlemsstats lagstiftning att tilldela sin kund en order efter att ordern överförts till handelsplatsen och ännu inte tilldelat sin kund ordern när ordern överförs ska den ordern identifieras i enlighet med fält 3 i tabell 2 i bilagan.
3. Om flera order överförs till handelsplatsen tillsammans som en ackumulerad order ska den ackumulerade ordern identifieras i enlighet med fält 3 i tabell 2 i bilagan.

Artikel 3

Handelskapacitet hos medlemmar eller deltagare på handelsplatsen och verksamhet för tillhandahållande av likviditet

1. Den handelskapacitet i vilken medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen skickar in en order ska beskrivas i enlighet med fält 7 i tabell 2 i bilagan.
2. Följande order ska identifieras i enlighet med fält 8 i tabell 2 i bilagan:
 - a) En order som överförts till en handelsplats av en medlem eller deltagare som en del i en marknadsgarantstrategi i enlighet med artiklarna 17 och 48 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU ⁽¹⁾.
 - b) En order som överförts till en handelsplats av en medlem eller deltagare som en del i någon annan verksamhet för tillhandahållande av likviditet som utförts på grundval av villkor som förutbestämts antingen av emittenten av det instrument som är föremål för ordern eller av handelsplatsen.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

Artikel 4

Registrering av datum och tidpunkt

1. Operatörer av handelsplatser ska föra register över datum och tidpunkt för varje händelse som förtecknas i fält 21 i tabell 2 i bilagan till denna förordning med den noggrannhetsnivå som anges i artikel 2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 ⁽¹⁾ såsom anges i fält 9 i tabell 2 i bilagan till denna förordning. Med undantag för registrering av datum och tid då order har avvisats av handelsplatsers system ska alla händelser som avses i fält 21 i tabell 2 i bilagan till denna förordning registreras med hjälp av klockor som används av handelsplatsers matchningsmotorer.
2. Operatörer av handelsplatser ska föra register över datum och tidpunkt för varje uppgift som förtecknas i fälten 49, 50 och 51 i tabell 2 i bilagan till denna förordning, med den noggrannhetsnivå som anges i artikel 2 i den delegerade förordningen (EU) 2017/574.

Artikel 5

Giltighetsperiod och orderbegränsningar

1. Operatörer av handelsplatser ska föra register över de giltighetsperioder och orderbegränsningar som förtecknas i fälten 10 och 11 i tabell 2 i bilagan.
2. Register över datum och tidpunkter avseende giltighetsperioder ska upprätthållas i enlighet med fält 12 i tabell 2 i bilagan för varje giltighetsperiod.

Artikel 6

Prioritet och ordningsnummer

1. Operatörer av handelsplatser som använder handelssystem med prioritet baserad på pris-synlighet-tid ska föra register över prioritetstidsstämplingen för samtliga order enligt fält 13 i tabell 2 i bilagan. Prioritetstidsstämplingen ska göras med samma noggrannhetsnivå som anges i artikel 4.1.
2. Operatörer av handelsplatser som använder handelssystem med prioritet baserad på storlek-tid ska föra register över de kvantiteter som avgör ordernas prioritet enligt fält 14 i tabell 2 i bilagan samt den prioritetstidsstämpling som avses i punkt 1.
3. Operatörer av handelsplatser som använder en kombination av prioritet baserad på pris-synlighet-tid och prioritet baserad på storlek-tid och redovisar order i sin orderbok med tidsprioritet ska uppfylla kraven i punkt 1.
4. Operatörer av handelsplatser som använder en kombination av prioritet baserad på pris-synlighet-tid och prioritet baserad på storlek-tid och redovisar order i sin orderbok med prioritet baserad på storlek-tid ska uppfylla kraven i punkt 2.
5. Operatörer av handelsplatser ska tilldela och upprätthålla ett ordningsnummer för alla händelser som anges i fält 15 i tabell 2 i bilagan.

Artikel 7

Identifieringskoder för order som avser finansiella instrument

1. Operatörer av handelsplatser ska upprätthålla en individuell identifieringskod för varje order enligt vad som anges i fält 20 i tabell 2 i bilagan. Identifieringskoden ska vara unik för varje orderbok, handelsdag och finansiellt instrument. Den ska gälla från det att operatören av handelsplatsen mottagit ordern fram till dess att ordern tagits bort från orderboken. Identifieringskoden ska även tillämpas för avvisade order oavsett orsaken till deras avvisning.

⁽¹⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 av den 7 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller noggrannhetsnivån för klockor (se sidan 148 i detta nummer av EUT).

2. Operatören av handelsplatsen ska bevara relevanta uppgifter om strategiorder med implicit funktion (*strategy order with implied functionality*, SOIF) som sprids till allmänheten såsom anges i bilagan. I fält 33 i tabell 2 i bilagan ska det anges att ordern är en implicit order.

Efter det att en SOIF har genomförts ska uppgifterna om den registreras av operatören av handelsplatsen i enlighet med bilagan.

Efter det att en SOIF har genomförts ska en kod för strategirelaterad orderidentifiering anges med hjälp av samma identifieringskod för samtliga order som är kopplade till den särskilda strategin. Koden för strategirelaterad orderidentifiering ska anges i enlighet med fält 46 i tabell 2 i bilagan.

3. Order som överförs till en handelsplats som tillåter en dirigeringsstrategi ska identifieras av den handelsplatsen som "dirigerad" enligt fält 33 i tabell 2 i bilagan när de dirigeras till en annan handelsplats. Order som överförs till en handelsplats som tillåter en dirigeringsstrategi ska behålla samma identifieringskod under sin livstid, oavsett om någon återstående kvantitet sätts tillbaka i orderboken.

Artikel 8

Händelser som påverkar order som avser finansiella instrument

Operatörer av handelsplatser ska föra register över de uppgifter som avses i fält 21 i tabell 2 i bilagan avseende de nya ordena.

Artikel 9

Typ av order som avser finansiella instrument

1. Operatörer av handelsplatser ska föra register över ordertypen för varje order som mottagits genom att använda sin egen klassificering enligt vad som anges i fält 22 i tabell 2 i bilagan.

2. Operatörer av handelsplatser ska klassificera varje mottagen order antingen som en limitorder eller som en stopporder i enlighet med fält 23 i tabell 2 i bilagan.

Artikel 10

Priser avseende order

Operatörer av handelsplatser ska föra register över alla prisrelaterade uppgifter som avses i avsnitt I i tabell 2 i bilagan i den mån de gäller ordena.

Artikel 11

Orderinstruktioner

Operatörer av handelsplatser ska föra register över samtliga orderinstruktioner som tagits emot för varje order enligt vad som anges i avsnitt J i tabell 2 i bilagan.

Artikel 12

Identifieringskod för handelsplatstransaktioner

Operatörer av handelsplatser ska upprätthålla en individuell identifieringskod för varje transaktion som följer av ett fullständigt eller partiellt genomförande av en order enligt vad som anges i fält 48 i tabell 2 i bilagan.

*Artikel 13***Handelsfaser och preliminära auktionspris och auktionsvolym**

1. Operatörer av handelsplatser ska föra register över de orderuppgifter som anges i avsnitt K i tabell 2 i bilagan.
2. Om behöriga myndigheter begär sådana detaljerade uppgifter som avses i avsnitt K i enlighet med artikel 1 ska de uppgifter som avses i fälten 9 och 15–18 i tabell 2 i bilagan också betraktas som uppgifter som gäller den order som berörs av begäran.

*Artikel 14***Ikraftträdande och tillämpning**

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Den ska tillämpas från och med den dag som anges i artikel 55 andra stycket i förordning (EU) nr 600/2014.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 24 juni 2016.

På kommissionens vägnar
Jean-Claude JUNCKER
Ordförande

BILAGA

Tabell 1

Teckenförklaring till tabell 2

SYMBOL	DATATYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Upp till n alfanumeriska tecken	Fritt textfält
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder
{DATE_TIME_FORMAT}	Datum- och tidformat enligt ISO 8601	Datum och tid anges i följande format: ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss.ddddddZ — "ÅÅÅÅ" är år — "MM" är månad — "DD" är dag — "T" – betyder att bokstaven T ska användas — "hh" är timme — "mm" är minut — "ss.dddddd" är sekund och dess fraktion av sekund — Z är UTC-tid Datum och tid ska rapporteras i UTC
{DATEFORMAT}	Datumformatet i ISO 8601	Datum ska formateras i följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Decimaltal med upp till n siffror totalt där upp till m siffror kan vara decimaler	Numeriska fält för både positiva och negativa värden — decimalseparator är "." (punkt) — negativa nummer föregås av "-" (minus) — värdena är avrundade och inte avkortade
{INTEGER-n}	Heltal på upp till n siffror totalt	Numeriska fält för både positiva och negativa heltal
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod i enlighet med definitionen i ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	Identitetsbeteckning för juridisk person i enlighet med definitionen i ISO 17442
{MIC}	4 alfanumeriska tecken	Identitetsbeteckning för marknad i enlighet med definitionen i ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alfanumeriska tecken	Identitetsbeteckning i enlighet med den som anges i artikel 6 och bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ⁽¹⁾

(1) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 av den 28 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder för rapportering av transaktioner till behöriga myndigheter (se sidan 449 i detta nummer av EUT).

Tabell 2

Orderuppgifter

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna			
1	Identifiering av enheten som lämnade in ordern	Identitet för medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen. Vid direkt elektronisk åtkomst (DEA) ska identiteten vara DEA-leverantörens identitet.	{LEI}
2	Direkt elektronisk åtkomst (DEA)	"true" vid de tillfällen ordern överlämnades till handelsplatsen med hjälp av DEA enligt definitionen i artikel 4.1.41 i direktiv 2014/65/EU. "false" vid de tillfällen ordern inte överlämnades till handelsplatsen med hjälp av DEA enligt definitionen i artikel 4.1.41 i direktiv 2014/65/EU.	"true" "false"
3	Identifieringskod för kund	Kod som används för att identifiera kunden till medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen Om DEA finns ska koden för DEA-användaren användas. Om kunden är en juridisk person ska kundens LEI-kod användas. Om kunden inte är en juridisk person ska {NATIONAL_ID} användas. Om det gäller ackumulerade order ska flaggan AGGR användas, i enlighet med artikel 2.3 i denna förordning. Om det gäller väntande tilldelningar ska flaggan PNAL användas, i enlighet med artikel 2.2 i denna förordning. Detta fält ska endast lämnas tomt om medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen inte har någon kund.	{LEI} {NATIONAL_ID} "AGGR" – ackumulerad order "PNAL" – väntande tilldelning
4	Investeringsbeslut inom firma	Kod för identifiering av den person eller algoritm vid medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen som ansvarar för investeringsbeslutet enligt artikel 8 i den delegerade förordningen (EU) 2017/590. Om en fysisk person vid medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen är ansvarig för investeringsbeslutet ska den person som är ansvarig eller har huvudansvaret för investeringsbeslutet identifieras med {NATIONAL_ID} Om en algoritm var ansvarig för investeringsbeslutet ska fältet fyllas i enligt vad som anges i artikel 8 i den delegerade förordningen (EU) 2017/590. Detta fält ska lämnas tomt när investeringsbeslutet inte har gjorts av en person eller algoritm inom medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen.	{NATIONAL_ID} – Fysisk person {ALPHANUM-50} – Algoritmer
5	Genomförande inom firma	Kod för identifiering av den person eller algoritm vid medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen som ansvarar för genomförandet av den transaktion som följer av order enligt artikel 9 i den delegerade förordningen (EU) 2017/590. Om en fysisk person är ansvarig för transaktionens genomförande ska personen i fråga identifieras med {NATIONAL_ID}	{NATIONAL_ID} – Fysisk person {ALPHANUM-50} – Algoritmer

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		Om en algoritm är ansvarig för genomförandet av transaktionen ska fältet fyllas i enligt artikel 9 i den delegerade förordningen (EU) 2017/590. Om mer än en person eller en kombination av personer och algoritmer är involverade i transaktionens genomförande ska handelsplatsens medlem eller deltagare eller kund avgöra den aktör eller algoritm som har huvudansvaret i enlighet med artikel 9.4 i den delegerade förordningen (EU) 2017/590 och fylla i detta fält med denna aktörs eller algoritms identitet.	
6	Icke-verkställande mäklare	I enlighet med artikel 2 d. Detta fält ska lämnas tomt när det inte är relevant.	{LEI}

Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet

7	Handelskapacitet	Anger om orderns inlämnande är ett resultat av att medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen utför matchad principalhandel i enlighet med artikel 4.38 i direktiv 2014/65/EU eller handel för egen räkning i enlighet med artikel 4.6 i direktiv 2014/65/EU. Om orderns inlämnande inte är ett resultat av att handelsplatsens medlem eller deltagare utför matchad principalhandel eller handel för egen räkning ska fältet visa att transaktionen genomfördes på annat sätt.	"DEAL" – Handel för egen räkning "MTCH" – Matchad principalhandel "AOTC" – Annan behörighet
8	Tillhandahållande av likviditet	Anger om en order lämnas in till en handelsplats som en del i en marknadsgarantstrategi i enlighet med artiklarna 17 och 48 i direktiv 2014/65/EU eller som en del i annan verksamhet i enlighet med artikel 3 i denna förordning.	"true" "false"

Avsnitt C – Datum och tid

9	Datum och tid	Datum och tid för varje händelse anges i avsnitt [G] och [K].	{DATE_TIME_FORMAT} Antalet siffror efter "sekunder" ska bestämmas i enlighet med artikel 2 i den delegerade förordningen (EU) 2017/574
---	---------------	---	---

Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar

10	Giltighetsperiod	Giltig under dagen (Good-For-Day): ordern annulleras i slutet av den handelsdag då den fördes in i orderboken. Giltig till annullerad (Good-Till-Cancelled): ordern kommer att förbli aktiv i orderboken och genomförbar fram till att den faktiskt annulleras.	"DAVY" – Giltig under dagen "GTCV" – Giltig till annullerad
----	------------------	--	--

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		<p>Giltig till tidpunkt (Good-Till-Time): ordern annulleras senast vid en förutbestämd tidpunkt inom den aktuella börsdagen.</p> <p>Giltig till datum (Good-Till-Date): ordern annulleras i slutet av ett specificerat datum.</p> <p>Giltig till specificerad tidpunkt och datum (Good-Till-Specified-Date-and-Time): ordern annulleras vid en specificerad tidpunkt och ett specificerat datum.</p> <p>Giltig efter tidpunkt (Good-After-Time): ordern är endast aktiv efter en förutbestämd tidpunkt inom den aktuella börsdagen.</p> <p>Giltig efter datum (Good-After-Date): ordern är endast aktiv från och med början av ett förutbestämt datum.</p> <p>Giltig efter specificerad tidpunkt och datum (Good-After-Specified-Date-and-Time): ordern är endast aktiv från och med början av en förutbestämd tidpunkt och ett förutbestämt datum.</p> <p>Genomför genast eller annullera (Immediate-Or-Cancel): en order som genomförs när den förs in i orderboken (i den kvantitet som kan genomföras) och som inte förblir i orderboken för den eventuella återstående kvantitet som inte har genomförts.</p> <p>Allt eller makulera (Fill-Or-Kill): en order som genomförs när den förs in i orderboken så länge den kan genomföras helt. Om den endast delvis kan genomföras kommer den omedelbart att avvisas och kan alltså inte genomföras.</p> <p>Annat: alla andra angivelser som är unika för specifika affärsmodeller, handelsplattformar eller system.</p>	<p>"GTTV" – Giltig till tidpunkt</p> <p>"GTDV" – Giltig till datum</p> <p>"GTSV" – Giltig till specificerad tidpunkt och datum</p> <p>"GATV" – Giltig efter tidpunkt</p> <p>"GADV" – Giltig efter datum</p> <p>"GASV" – Giltig efter specificerad tidpunkt och datum</p> <p>"IOCV" – Genomför genast eller annullera</p> <p>"FOKV" – Allt eller makulera eller {ALPHANUM-4} tecken som inte redan används för handelsplatsens egen klassificering.</p>
11	Orderrestriktioner	<p>Giltig för <i>crossing session</i> till slutpris (Good For Closing Price Crossing Session): när en order är kvalificerad för en <i>crossing session</i> till slutpris.</p> <p>Giltig för auktion (Valid For Auction): ordern är bara aktiv och kan endast genomföras under auktionsfaser (som kan vara fördefinierade av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen som lämnat in ordern, t.ex. öppnings- och/eller stängningsauktioner och/eller intradagsauktioner).</p> <p>Endast giltig för kontinuerlig handel (Valid For Continuous Trading only): ordern är endast aktiv under kontinuerlig handel.</p>	<p>"SESr" – Giltig för <i>crossing session</i> till slutpris</p> <p>"VFAR" – Giltig för auktion</p> <p>"VFCR" – Endast giltig för kontinuerlig handel</p>

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		Annat: alla andra angivelser som är unika för specifika affärsmodeller, handelsplattformar eller system.	{ALPHANUM-4} tecken som inte redan används för handelsplatsens egen klassificering. Detta fält ska fyllas i med flera flaggor, åtskilda med komma-tecken om flera typer är tillämpliga.
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	<p>Detta hänvisar till den tidsstämpel som visar den tidpunkt då ordern blir aktiv eller då ordern slutligen tas bort från orderboken.</p> <p>Giltig under dagen: registreringsdatum med tidsstämpel precis före midnatt.</p> <p>Giltig till tidpunkt: registreringsdatum och den tidpunkt som specificeras i ordern.</p> <p>Giltig till datum: det specificerade utgångsdatumet med tidsstämpel precis före midnatt.</p> <p>Giltig till specificerad tidpunkt och datum: det specificerade utgångsdatumet och den specificerade utgångstiden.</p> <p>Giltig efter tidpunkt: registreringsdatum och den specificerade tidpunkt då ordern blir aktiv.</p> <p>Giltig efter datum: det specificerade datumet med tidsstämpel precis efter midnatt.</p> <p>Giltig efter specificerad tidpunkt och datum: det specificerade datumet och den specificerade tidpunkten då ordern blir aktiv.</p> <p>Giltig till annullerad: det slutliga datum och den slutliga tidpunkt då orden automatiskt tas bort genom marknadsoperationer.</p> <p>Annat: tidsstämpel för alla ytterligare giltighetstyper.</p>	{DATE_TIME_FORMAT} Antalet siffror efter "sekunder" bestäms i enlighet med artikel 2 i den delegerade förordningen (EU) 2017/574.

Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer

13	Tidsstämpel för prioritet	Detta fält ska uppdateras varje gång en orders prioritet ändras.	{DATE_TIME_FORMAT} Antalet siffror efter "sekunder" bestäms i enlighet med artikel 2 i den delegerade förordningen (EU) 2017/574.
14	Prioriterad storlek	<p>För handelsplatser som använder prioritet baserad på storlektid ska detta fält fyllas i med ett positivt tal som motsvarar kvantiteten.</p> <p>Detta fält ska uppdateras varje gång orderns prioritet ändras.</p>	Upp till 20 numeriska positiva siffror.
15	Ordningsnummer	<p>Varje händelse som anges i avsnitt G ska identifieras med hjälp av positiva heltal i stigande ordning.</p> <p>Ordningsnumret ska vara unikt för varje händelsetyp, konsekvent för alla händelser tidsstämlade av handelsplatsoperatören och bestående för den dag då händelsen inträffar.</p>	{INTEGER-50}

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
----	------	--	--

Avsnitt F – Identifiering av ordern

16	MIC-kod för segment	Anger handelsplatsen där ordern lämnades in. Om handelsplatsen använder MIC för segment ska MIC för segment användas. Om handelsplatsen inte använder MIC för segment ska operativa MIC användas.	{MIC}
17	Orderbokskod	Den alfanumeriska kod som fastställts av handelsplatsen för varje orderbok.	{ALPHANUM-20}
18	Identifieringskod för finansiella instrument	Unik och otvetydig identifikation för det finansiella instrumentet	{ISIN}
19	Datum för mottagande	Datum för mottagande av originalordern.	{DATEFORMAT}
20	Identifieringskod för ordern	En alfanumerisk kod som tilldelats av handelsplatsens operatör till den enskilda ordern.	{ALPHANUM-50}

Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern

21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvis genomförande	<p>Ny order: mottagande av en ny order av handelsplatsoperatören.</p> <p>Utlöst: en order som blir genomförbar eller icke-genomförbar när ett förutbestämt villkor inträffar.</p> <p>Ersatt av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen: där en medlem, deltagare eller kund på handelsplatsen beslutar sig för att på eget initiativ ändra någon egenskap av en order som denna tidigare har fört in i orderboken.</p> <p>Ersatt genom marknadsoperationer (automatisk): när någon av en orders egenskaper ändras av handelsplatsoperatörens it-system. Detta omfattar de fall där en peg-orders eller en trailing stop-orders aktuella egenskaper ändras för att återspegla var ordern är belägen i orderboken.</p> <p>Ersatt genom marknadsoperationer (mänsklig aktör): när en orders egenskaper ändras av handelsplatsoperatörens personal. Detta inkluderar situationer då en medlem, deltagare eller kund på en handelsplats har it-problem och omedelbart behöver få sina order annullerade.</p> <p>Statusförändring på initiativ av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen. Detta omfattar aktivering och deaktivering.</p>	<p>"NEWO" – Ny order</p> <p>"TRIG" – Utlöst</p> <p>"REME" – Ersatt av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen</p> <p>"REMA" – Ersatt genom marknadsoperationer (automatisk)</p> <p>"REMH" – Ersatt genom marknadsoperationer (mänsklig aktör)</p> <p>"CHME" – Statusförändring på initiativ av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen</p>
----	---	--	--

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		<p>Statusförändring genom marknadsoperationer.</p> <p>Annullerad på initiativ av medlemmen eller deltagaren på handelsplatsen: då en medlem, deltagare eller kund på eget initiativ beslutar sig för att annullera en tidigare införd order.</p> <p>Annullerad genom marknadsoperationer. Detta inkluderar en skyddsmekanism som tillhandahålls till värdepappersföretag som utför en marknadsgarantsverksamhet enligt artiklarna 17 och 48 i direktiv 2014/65/EU.</p> <p>Avvisad order: en ny order mottagen men avvisad av handelsplatsoperatören.</p> <p>Utgången order: där ordern tas bort från orderboken vid slutet av sin giltighetsperiod.</p> <p>Delvis fylld: där orden inte är fullt genomförd så att det finns kvar en mängd som ska genomföras.</p> <p>Fylld: där det inte finns någon mängd kvar som ska genomföras.</p>	<p>"CHMO" – Statusförändring genom marknadsoperationer.</p> <p>"CAME" – Annullerad på initiativ av medlemmen/deltagaren på handelsplatsen</p> <p>"CAMO" – Annullerad genom marknadsoperationer</p> <p>"REMO" – Avvisad order</p> <p>"EXPI" – Utgången order</p> <p>"PARF" – Delvis fylld</p> <p>"FILL" – Fylld {ALPHANUM-4} tecken som inte redan används för handelsplatsens egen klassificering.</p>

Avsnitt H – Ordertyp

22	Ordertyp	Anger typ av order som lämnats in till handelsplatsen i enlighet med handelsplatsens specifikationer.	{ALPHANUM-50}
23	Klassificering av ordertyp	<p>Klassificering av ordern enligt två generiska ordertyper. LIMIT-order: i de fall då ordern kan handlas och</p> <p>STOP-order: i de fall då ordern kan handlas enbart då en förutbestämd prishändelse inträffar.</p>	Bokstäverna "LMTO" används för LIMIT och "STOP" för STOP.

Avsnitt I – Priser

24	Gränspris	<p>Det maxpris till vilken en köporder är tillgänglig för handel eller det minimipris då en säljorder är tillgänglig för handel.</p> <p>Spreadpris för en strategiorder. Det kan vara negativt eller positivt.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} om priset uttrycks som ett monetärt värde</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p>
----	-----------	--	--

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		<p>Om det gäller en order som inte har något gränspris eller en order som inte är prissatt ska detta fält lämnas tomt.</p> <p>Om det gäller en konvertibel obligation ska det verkliga priset (rent/clean eller totalt/dirty) som används för ordern återspeglas i detta fält</p>	<p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset uttrycks som baspunkter.</p>
25	Ytterligare gränspris	Andra gränspriser som kan vara tillämpliga på ordern. Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.	<p>{DECIMAL-18/13} om priset uttrycks som ett monetärt värde</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset uttrycks som baspunkter</p>
26	Stoppris	<p>Det pris som måste uppnås för att ordern ska bli aktiv.</p> <p>Om det gäller stopporder som utlöses av händelser som är oberoende av priset på det finansiella instrumentet ska detta fält fyllas i med ett stoppris lika med noll.</p> <p>Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} om priset uttrycks som ett monetärt värde</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset uttrycks som baspunkter</p>
27	Peggat gränspris	<p>Det maxpris till vilken en peggat köporder är tillgänglig för handel eller det minimipris då en peggat säljorder är tillgänglig för handel.</p> <p>Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} om priset uttrycks som ett monetärt värde</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset uttrycks som baspunkter</p>

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
28	Transaktionspris	<p>Handlat pris för transaktionen exklusive, i de fall det är tillämpligt, provision och ackumulerad ränta.</p> <p>För optionskontrakt gäller premien för derivatavtalet per underliggande tillgång eller indexpunkt.</p> <p>För spreadbetting gäller referenspriset för det direkt underliggande instrumentet.</p> <p>För creditswappar (CDS) gäller kupongen i baspunkter.</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p> <p>Där pris inte är tillämpligt ska fältet fyllas i med värdet "NOAP".</p>	<p>{DECIMAL-18/13} om priset uttrycks som ett monetärt värde</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset uttrycks som baspunkter</p> <p>"NOAP"</p>
29	Prisvaluta	Den valuta som det handlade priset uttrycks i för det finansiella instrument som ordern gäller (gäller om priset är uttryckt som ett monetärt värde).	{CURRENCYCODE_3}
30	Valuta för del 2	<p>När det rör sig om valutaswappar eller valutaswappar i flera valutor ska valutan för del 2 vara den valuta i vilken del 2 i avtalet uttrycks.</p> <p>För swaptioner där den underliggande swappen är i flera valutor ska valutan för del 2 vara den valuta i vilken del 2 av swappen uttrycks.</p> <p>Detta fält behöver endast fyllas i om det finns ränte- och valutaderivatavtal</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Prisnotering	Anger om priset uttrycks i monetärt värde, procent, avkastning eller baspunkter.	<p>"MONE" – Monetärt värde</p> <p>"PERC" – Procent</p> <p>"YIEL" – Avkastning</p> <p>"BAPO" – Baspunkter</p>

Avsnitt J – Orderinstruktioner

32	Köp/sälj-indikator	<p>För att visa om ordern är att köpa eller sälja.</p> <p>Vid optioner och swaptioner ska köparen vara den motpart som innehar rätten att utnyttja optionen och säljaren vara motpart som säljer optionen och får en premie.</p> <p>Vid andra terminskontrakt än valutaterminskontrakt ska köparen vara motparten som köper instrumentet och säljaren motparten som säljer instrumentet.</p> <p>När det gäller swappar som gäller värdepapper ska köparen vara motparten som får risken för prisrörelsen på det underliggande värdepappret och får beloppet för värdepappret. Säljaren ska vara motparten som betalar beloppet för värdepappret.</p>	<p>"BUYI" – köp</p> <p>"SELL" – sälj</p>
----	--------------------	--	--

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
		<p>När det gäller swappar kopplade till räntor eller inflationsindex ska köparen vara motparten som betalar den fasta räntan. Säljaren ska vara motparten som får den fasta räntan. Vid basisswappar (float-to-float ränteswappar) ska köparen vara motparten som betalar spreaden och säljaren motparten som tar emot spreaden.</p> <p>När det gäller swappar och terminer kopplade till valutor och valutaswappar ska köparen vara motparten som får den valuta som är först när dessa sorteras i alfabetisk ordning enligt ISO 4217-standarden och säljaren ska vara motparten som levererar denna valuta.</p> <p>När det gäller swappar kopplade till utdelning ska köparen vara motparten som tar emot den motsvarande faktiska utdelningen. Säljare är motparten som betalar utdelningen och får den fasta räntan.</p> <p>När det gäller derivatinstrument för överföring av kreditrisk förutom för optioner och swaptioner ska köparen vara motparten som köper skyddet. Säljaren är motpartens som säljer skyddet.</p> <p>Vid derivatkontrakt kopplade till råvaror eller utsläppsrätter ska köparen vara motparten som tar emot varan eller utsläppsrätten som specificeras i rapporten och säljaren vara motparten som levererar denna råvara eller utsläppsrätt.</p> <p>Vid ränteterminer ska köparen vara motparten som betalar den fasta räntan och säljaren motparten som får den fasta räntan.</p> <p>För en nominell ökning ska köparen vara densamma som förvärvaren av det finansiella instrumentet i den ursprungliga transaktionen och säljaren ska vara densamma som avyttraren av det finansiella instrumentet i den ursprungliga transaktionen.</p> <p>För en nominell sänkning ska köparen vara densamma som avyttraren av det finansiella instrumentet i den ursprungliga transaktionen och säljaren ska vara densamma som förvärvaren av det finansiella instrumentet i den ursprungliga transaktionen.</p>	
33	Orderstatus	<p>För att identifiera order som är aktiva/inaktiva/stoppade, fasta/vägledande (tilldelas endast bud)/implicita/omdirigerade.</p> <p>Aktiv – ej budrelaterade order som är tillgängliga för handel.</p> <p>Inaktiv – ej budrelaterade order som inte är tillgängliga för handel.</p> <p>Fast/vägledande – Tilldelas endast bud. Vägledande bud innebär att de är synliga men inte kan genomföras. Detta inkluderar warranter på vissa handelsplatser. Fasta bud kan genomföras.</p> <p>Implicit – Används för strategiorder som härrör från en funktion <i>implied in</i> eller <i>implied out</i>.</p> <p>Dirigerad – Används för order som dirigeras av handelsplatsen till andra handelsplatser.</p>	<p>”ACTI” – aktiv eller</p> <p>”INAC” – inaktiv eller</p> <p>”FIRM” – fasta bud eller</p> <p>”INDI” – vägledande bud eller</p> <p>”IMPL” – implicita strategiorder eller</p> <p>”ROUT” – dirigerade order.</p> <p>Om fler än en status är tillämplig ska detta fält fyllas i med flera flaggor som separeras av komman.</p>

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
34	Kvantitetsnotering	Anger om den kvantitet som rapporterats är uttryckt i antal enheter, i nominellt värde eller som ett monetärt värde.	"UNIT" – Antal enheter "NOML" – Nominellt värde "MONE" – Monetärt värde
35	Valutakvantitet	Den valuta som kvantiteten är uttryckt i. Fältet behöver endast fyllas i om kvantiteten är uttryckt som ett nominellt eller monetärt värde.	{CURRENCYCODE_3}
36	Ursprunglig kvantitet	Antal enheter av det finansiella instrumentet, eller antalet derivatkontrakt i ordern. Det nominella eller monetära värdet av det finansiella instrumentet. För spreadbetting ska kvantiteten vara det monetära värde som satsats per punktförändring i det underliggande finansiella instrumentet. För ökning eller minskning av nominella derivatkontrakt ska antalet återspegla det absoluta värdet av förändringen och uttryckas som ett positivt tal. För creditswappar ska kvantiteten vara det nominella belopp för vilket skyddet förvärvs eller avyttras.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	Den totala kvantitet som finns kvar i orderboken efter ett partiellt genomförande eller vid någon annan händelse som påverkar ordern. För en delvis fylld order ska detta vara den totala återstående volymen efter det partiella genomförandet. För en orderläggning ska detta att motsvara den ursprungliga kvantiteten.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som ett antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde
38	Visad kvantitet	Den kvantitet som är synlig (i motsats till den dolda) i orderboken.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som ett antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde
39	Handlad kvantitet	Vid fullständigt eller partiellt genomförande ska detta fält fyllas i med den genomförda kvantiteten.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som ett antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde
40	Lägsta godtagbara kvantitet (MAQ)	Detta är den lägsta godtagbara kvantiteten för att fylla en order som kan bestå av flera partiella genomföranden och normalt sett endast är för icke-bestående ordertyper. Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som ett antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
41	Minsta genomförbara storlek (MES)	Den minsta genomförbara storleken för varje enskilt genomförande. Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.	{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som ett antal enheter {DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde
42	MES endast för första genomförandet	Anger om MES endast är relevant för det första genomförandet. Detta fält kan lämnas tomt om fält 41 är tomt.	"true" "false"
43	Indikator för endast passiv	Anger om ordern lämnas in till handelsplatsen med ett kännetecken/en flagga för att ordern inte omedelbart ska genomföras mot eventuella synliga motorder.	"true" "false"
44	Indikator för passiv eller aggressiv	För delvis fyllda order och fyllda order anges här om ordern redan vilade i orderboken och tillhandahöll likviditet (passiv) eller om ordern inledde handeln och därmed tog likviditet (aggressiv). Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.	"PASV" – passiv eller "AGRE" – aggressiv.
45	Skydd mot eget genomförande	Anger om ordern har förts in med ett skydd mot ett eget genomförande så att den inte genomförs med en order på den motsatta sidan av boken som förts in av samma medlem eller deltagare.	"true" "false"
46	Identifiering av strategirelaterad order	Den alfanumeriska kod som används för att länka alla kopplade order som är en del av en strategi enligt artikel 7.2.	{ALPHANUM-50}
47	Dirigeringsstrategi	Den tillämpliga dirigeringsstrategin i enlighet med handelsplatsens specifikationer. Detta fält ska lämnas tomt om det inte är relevant.	{ALPHANUM-50}
48	Identifikationskod för handelsplatstransaktioner	Alfanumerisk kod som handelsplatsen har tilldelat transaktionen i enlighet med artikel 12 i denna förordning. Identifikationskoden för handelsplatstransaktioner ska vara unik, konsekvent och bestående per ISO 10383 MIC för segment och per handelsdag. Om handelsplatsen inte använder MIC för segment ska identifikationskoden för handelsplatstransaktioner vara unik, konsekvent och bestående per operativ MIC per handelsdag. Komponenterna av identifikationskoden ska inte visa identiteten av motparterna i de transaktioner som koden upprätthålls för.	{ALPHANUM-52}

Nr	Fält	Innehållet i orderuppgifter som ska hållas tillgängliga för den behöriga myndigheten	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls till den behöriga myndigheten
----	------	--	--

Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym

49	Handelsfaser	Namnet på alla de olika handelsfaser under vilka en order finns i orderboken, inklusive handelsstopp, handelsspärrar och tillfälliga stopp.	{ALPHANUM-50}
50	Vägledande auktionspris	Det pris till vilket fördelning kan ske vid varje auktion (uncross) för det finansiella instrumentet för vilket en eller flera order har lämnats in.	<p>{DECIMAL-18/5} om priset uttrycks som monetärt eller nominellt värde</p> <p>När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten.</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset uttrycks som procent eller avkastning.</p>
51	Vägledande auktionsvolym	Den volym (antal enheter av det finansiella instrumentet) som kan genomföras för det vägledande auktionspriset i fält 50 om auktionen avslutades vid den exakta tidpunkten.	<p>{DECIMAL-18/17} om mängden uttrycks som antal enheter</p> <p>{DECIMAL-18/5} om mängden uttrycks som monetärt eller nominellt värde</p>