



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 24. Juni 2016
(OR. en)

10650/16
ADD 1

EF 205
ECOFIN 653
DELECT 126

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender: Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission

Eingangsdatum: 24. Juni 2016

Empfänger: Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union

Nr. Komm.dok.: C(2016) 3821 final ANNEX 1

Betr.: ANHÄNGE zur DELEGIERTEN VERODNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 3821 final ANNEX 1.

Anl.: C(2016) 3821 final ANNEX 1



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 24.6.2016
C(2016) 3821 final

ANNEX 1

ANHÄNGE

zur

DELEGIERTEN VERODNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION

**zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und
des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger
Daten über Aufträge für Finanzinstrumente**

ANHANG

Tabelle 1

Legende zu Tabelle 2

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld
{CURRENCYCO DE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß ISO 4217
{DATE_TIME_FO RMAT}	Datums- und Zeitformat nach ISO 8601	Datum und Uhrzeit in folgendem Format: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dzzzzzZ <ul style="list-style-type: none">- - „YYYY“ bezeichnet das Jahr.- - „MM“ bezeichnet den Monat.- - „DD“ bezeichnet den Tag.- - „T“ bedeutet, dass der Buchstabe „T“ verwendet werden soll.- - „hh“ bezeichnet die Stunde.- - „mm“ bezeichnet die Minute.- - „ss.dzzzzz“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde.- - Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit). Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben.
{DATEFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Das Datum ist in folgendem Format anzugeben: YYYY-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen insgesamt, wovon bis zu m Stellen Nachkommastelle n sein können	Numerisches Feld für positive und negative Werte: <ul style="list-style-type: none">- - Dezimaltrennzeichen ist der Punkt (.);- - negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt;- - Werte werden gerundet und nicht abgeschnitten.
{INTEGER-n}	Ganze Zahl mit bis zu n Ziffern insgesamt	Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Kennung für juristische Personen gemäß ISO 17442
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	Codes für die Identifizierung von Handelsplätzen gemäß ISO 10383

{NATIONAL_ID}	35 alphanumerische Zeichen	Kennung, die in Artikel 6 und Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) der Kommission über Meldepflichten gemäß Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 festgelegt ist.
---------------	----------------------------------	--

Tabelle 2

Auftragsdaten

Nr.	Feld	Auftragsdaten, die für die zuständige Behörde zur Verfügung gehalten werden müssen	Standards und Formate der Auftragsdaten, in denen die einschlägigen Daten der zuständigen Behörde auf Anfrage zur Verfügung zu stellen sind
Abschnitt A – Identifizierung der einschlägigen Parteien			
1	Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat	Die Identität des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes. Bei direktem elektronischem Zugang (DEA) ist die Identität des DEA-Bereitstellers anzugeben.	{LEI}
2	Direkter elektronischer Zugang (DEA)	„zutreffend“, wenn der Auftrag über einen direkten elektronischen Zugang (im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 41 der Richtlinie (EU) 2014/65) an den Handelsplatz übermittelt wurde. „nicht zutreffend“, wenn der Auftrag nicht über einen direkten elektronischen Zugang (im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 41 der Richtlinie (EU) 2014/65) an den Handelsplatz übermittelt wurde.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
3	Kundenidentifikationscode	Code zur Identifikation des Kunden des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes. Im Falle eines direkten elektronischen Zugangs ist der Code des DEA-Nutzers anzugeben. Wenn der Kunde eine juristische Person ist, ist der LEI-Code des Kunden zu verwenden. Ist der Kunde keine juristische Person, ist die {NATIONAL_ID} zu verwenden. Bei Sammelaufträgen ist das Kennzeichen „AGGR“ zu verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 3 der nach Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission über die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente ¹). Wenn die Zuweisung des Auftrags noch aussteht, ist das Kennzeichen „PNAL“ zu verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 2 der nach Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission über die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente). Dieses Feld ist nur dann leer zu lassen, wenn das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes keinen Kunden hat.	{LEI} {NATIONAL_ID} „AGGR“ – Sammelaufträge „PNAL“ – Zuweisung ausstehend

¹ [Bitte vollständigen Titel des Rechtsakts einfügen] (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

4	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	<p>Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, die oder der für die Anlageentscheidung verantwortlich ist (siehe Artikel 8 der nach Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) der Kommission über Transaktionsmeldungen².</p> <p>Ist eine natürliche Person bei dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes für die Anlageentscheidung verantwortlich, ist die für die Anlageentscheidung verantwortliche oder vorrangig verantwortliche Person mit ihrer {NATIONAL_ID} anzugeben.</p> <p>Wurde die Anlageentscheidung durch einen Algorithmus getroffen, ist das Feld gemäß Artikel 8 der nach Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission über Transaktionsmeldungen auszufüllen.</p> <p>Dieses Feld ist leer zu lassen, wenn die Anlageentscheidung nicht von einer Person oder einem Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes getroffen wurde.</p>	<p>{NATIONAL_ID} – natürliche Person</p> <p>{ALPHANUM-50} – Algorithmus</p>
5	Ausführung innerhalb der Firma	<p>Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus beim Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, die oder der für die Ausführung des aus dem Auftrag resultierenden Geschäfts verantwortlich ist (siehe Artikel 9 der nach Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) über Transaktionsmeldungen). Ist für die Ausführung des Geschäfts eine natürliche Person verantwortlich, ist die Person mit ihrer {NATIONAL_ID} anzugeben.</p> <p>Ist für die Ausführung des Geschäfts ein Algorithmus verantwortlich, ist das Feld gemäß Artikel 9 der nach Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) der Kommission über Transaktionsmeldungen auszufüllen.</p> <p>Wenn mehr als eine Person oder sowohl Personen als auch Algorithmen an der Ausführung des Geschäfts beteiligt sind, bestimmt das Mitglied, der Teilnehmer oder der Kunde des Handelsplatzes den vorrangig verantwortlichen Händler oder Algorithmus (siehe Artikel 9 Absatz 4 der</p>	<p>{NATIONAL_ID} – natürliche Person</p> <p>{ALPHANUM-50} – Algorithmus</p>

² [Bitte vollständigen Titel des Rechtsakts einfügen] (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		nach Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erlassenen Delegierten Verordnung (EU) der Kommission über Transaktionsmeldungen) und trägt in dieses Feld die Kennung dieses Händlers oder Algorithmus ein.	
6	Nicht ausführender Makler	Gemäß Artikel 2 Buchstabe d. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{LEI}
Abschnitt B – Handelskapazität und Liquiditätszufuhr			
7	Handelskapazität	Gibt an, ob der Auftragseingang daraus resultiert, dass das Mitglied oder der Teilnehmer des Handelsplatzes im Sinne von Artikel 4 Nummer 38 der Richtlinie 2014/65/EU sich deckende Kundenaufträge zusammenführt oder im Sinne von Artikel 4 Nummer 6 der Richtlinie 2014/65/EU Handel für eigene Rechnung betreibt. Resultiert der Auftragseingang nicht aus einer Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge oder dem Handel für eigene Rechnung, ist in diesem Feld anzugeben, dass das Geschäft im Rahmen anderer Kapazitäten ausgeführt wurde.	„DEAL“ – Handel für eigene Rechnung „MTCH“ – Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge „AOTC“ – andere Kapazität
8	Liquiditätszufuhr	Gibt an, ob ein Auftrag im Rahmen einer Market-Making-Strategie gemäß der Artikel 17 und 48 der Richtlinie 2014/65/EU oder im Rahmen einer sonstigen Tätigkeit gemäß Artikel 3 dieser Verordnung an einen Handelsplatz weitergeleitet wird.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
Abschnitt C – Datum und Uhrzeit			
9	Datum und Uhrzeit	Datum und Uhrzeit für jedes in den Abschnitten [G] und [K] aufgeführte Ereignis.	{DATE_TIME_FORMAT} Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Artikel 2 der nach Artikel 50 der Richtlinie 2014/65/EU erlassenen Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission über die Synchronisierung von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren zu bestimmen.
Abschnitt D – Gültigkeitsdauer und Auftragsbeschränkungen			
10	Gültigkeitsdauer	Good-For-Day: Der Auftrag erlischt am Ende des Handelstags, an dem er in das Orderbuch eingegeben wurde. Good-Till-Cancelled: Der Auftrag ist so lange im Orderbuch aktiv und ist ausführbar, bis er storniert wird. Good-Till-Time: Der Auftrag erlischt	„DAVY“ – Good-For-Day „GTCV“ – Good-Till-Cancelled „GTTV“ – Good-Till-Time

		<p>spätestens zu einer festgesetzten Uhrzeit am aktuellen Geschäftstag.</p> <p>Good-Till-Date: Der Auftrag erlischt nach Ablauf eines bestimmten Datums.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time: Der Auftrag erlischt an einem bestimmten Datum zu einer bestimmten Uhrzeit.</p> <p>Good After Time: Der Auftrag ist erst nach Ablauf einer festgesetzten Uhrzeit am aktuellen Geschäftstag aktiv.</p> <p>Good After Date: Der Auftrag ist erst ab einem festgesetzten Datum aktiv.</p> <p>Good After Specified Date and Time: Der Auftrag ist erst ab einer festgesetzten Uhrzeit am festgesetzten Datum aktiv.</p> <p>Immediate-Or-Cancel: ein Auftrag, der bei seiner Eingabe ins Orderbuch sofort (für die ausführbare Menge) ausgeführt wird und der für die restliche Menge (sofern vorhanden), die nicht ausgeführt werden konnte, nicht im Orderbuch verbleibt.</p> <p>Fill-Or-Kill: ein Auftrag, der bei seiner Eingabe ins Orderbuch sofort ausgeführt wird, sofern er vollständig ausgeführt werden kann. Falls der Auftrag nur teilweise ausgeführt werden kann, wird er automatisch zurückgewiesen und kann somit nicht ausgeführt werden.</p> <p>Sonstige: alle weiteren Angaben, die speziell für bestimmte Geschäftsmodelle, Handelsplattformen oder Handelssysteme gelten.</p>	<p>„GTDV“ – Good-Till-Date</p> <p>„GTSV“ – Good-Till-Specified Date and Time</p> <p>„GATV“ – Good After Time</p> <p>„GADV“ – Good After Date</p> <p>„GASV“ – Good After Specified Date and Time</p> <p>„IOCV“ – Immediate-Or-Cancel oder</p> <p>„FOKV“ – Fill-Or-Kill oder {ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p>
11	Auftragsbeschränkung	<p>Good For Closing Price Crossing Session: wenn sich ein Auftrag für den Schlusskurs einer Crossing Session qualifiziert.</p> <p>Valid For Auction: Der Auftrag ist nur während Auktionsphasen aktiv und kann nur in diesen Phasen ausgeführt werden (diese können von dem Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes, das/der den Auftrag eingereicht hat, festgelegt werden, wie Eröffnungs- und/ Schlussauktionen und/oder Auktionen</p>	<p>„SESR“ – Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>„VFAR“ – Valid For Auction</p> <p>„VFCR“ – Valid For Continuous Trading only</p>

		<p>innerhalb eines Tages).</p> <p>Valid For Continuous Trading only: Der Auftrag ist nur während des fortlaufenden Handels aktiv.</p> <p>Sonstige: alle weiteren Angaben, die speziell für bestimmte Geschäftsmodelle, Handelsplattformen oder Handelssysteme gelten.</p>	<p>{ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p> <p>Treffen mehrere Möglichkeiten zu, sind diese hier durch Kommata getrennt anzugeben.</p>
12	Datum und Uhrzeit der Gültigkeitsdauer	<p>Diese Angabe bezieht sich auf den Zeitstempel, der den Zeitpunkt wiedergibt, zu dem der Auftrag aktiv wird oder definitiv aus dem Orderbuch gelöscht wird.</p> <p>Good-For-Day: Eingangsdatum mit einem Zeitstempel unmittelbar vor Mitternacht.</p> <p>Good-Till-Time: Eingangsdatum und im Auftrag angegebene Uhrzeit.</p> <p>Good-Till-Date: angegebenes Ablaufdatum mit einem Zeitstempel unmittelbar vor Mitternacht.</p> <p>Good-Till-Specified Date and Time: für den Ablauf der Gültigkeit angegebenes Datum und angegebene Uhrzeit.</p> <p>Good After Time: Eingangsdatum und angegebene Uhrzeit, zu der der Auftrag aktiv wird.</p> <p>Good After Date: angegebenes Datum mit einem Zeitstempel unmittelbar nach Mitternacht.</p> <p>Good After Specified Date and Time: angegebenes Datum und angegebene Uhrzeit, zu der der Auftrag aktiv wird.</p> <p>Good-Till-Cancelled: letztes Datum und letzte Uhrzeit, zu dem der Auftrag infolge des Handelsbetriebs automatisch gelöscht wird.</p> <p>Sonstige: Zeitstempel für jeden weiteren Gültigkeitstyp,</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission über die Synchronisierung von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren zu bestimmen.</p>
- Abschnitt E – Priorität und laufende Nummer			
13	Zeitstempel zur Priorisierung von Aufträgen	<p>Dieses Feld ist jeweils zu aktualisieren, wenn sich die Priorität eines Auftrags ändert.</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ wird gemäß Artikel 2 des</p>

			[nach Artikel 50 der Richtlinie 2014/65/EU erlassenen technischen Regulierungsstandards über die Synchronisierung von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren] bestimmt.
14	Prioritätsvolumen	Bei Handelsplätzen, die Volumen-Zeit-Priorität verwenden, ist in dieses Feld eine positive Zahl einzutragen, die der Menge entspricht. Dieses Feld ist jeweils zu aktualisieren, wenn sich die Priorität des Auftrags ändert.	Bis zu 20 positive numerische Zeichen
15	Laufende Nummer	Jedes in Abschnitt G aufgeführte Ereignis ist durch positive Ganzzahlen in aufsteigender Reihenfolge zu identifizieren. Für jeden Ereignistyp darf nur eine laufende Nummer vergeben werden, diese muss über alle vom Handelsplatzbetreiber mit einem Zeitstempel versehenen Ereignisse konsistent sein, und sie muss für das Datum, an dem das Ereignis eintritt, fortbestehen.	{INTEGER-50}
Abschnitt F – Identifikation des Auftrags			
16	Segment MIC	Kennung des Handelsplatzes, an dem der Auftrag eingereicht wurde. Verwendet der Handelsplatz Segment MICs, dann ist der Segment MIC zu verwenden. Verwendet der Handelsplatz keine Segment MICs, dann ist der Operating MIC zu verwenden.	{MIC}
17	Orderbuch-Code	Der vom Handelsplatz für jedes Orderbuch festgelegte alphanumerische Code	{ALPHANUM-20}
18	Identifikationscode des Finanzinstruments	Eindeutige Kennung des Finanzinstruments	{ISIN}
19	Eingangsdatum	Eingangsdatum des ursprünglichen Auftrags	{DATEFORMAT}
20	Auftragsidentifikationscode	Ein alphanumerischer Code, der einem einzelnen Auftrag vom Handelsplatzbetreiber zugewiesen wird	{ALPHANUM-50}
Abschnitt G – Ereignisse mit Auswirkungen auf den Auftrag			
21	Neuer Auftrag, Ändern des Auftrags, Stornieren des Auftrags, Zurückweisen des Auftrags, vollständige oder teilweise	Neuer Auftrag: Eingang eines neuen Auftrags beim Betreiber des Handelsplatzes. Ausgelöst: ein Auftrag, der bei Eintreten einer zuvor festgelegten Bedingung ausführbar oder ggf. nicht ausführbar wird.	„NEWO“ – neuer Auftrag „TRIG“ – ausgelöst

Ausführung	<p>Vom Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes ersetzt: wenn ein Mitglied, ein Teilnehmer oder ein Kunde des Handelsplatzes auf eigene Initiative beschließt, Merkmale des zuvor von ihm in das Orderbuch eingegebenen Auftrags zu ändern.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs ersetzt (automatisch): wenn Merkmale eines Auftrags durch die IT-Systeme des Handelsplatzbetreibers geändert werden. Dies umfasst auch die Änderung der aktuellen Merkmale einer Pegged-Order oder Trailing-Stop-Order, um die Position des Auftrags im Orderbuch wiederzugeben.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs ersetzt (menschliches Eingreifen): wenn ein Merkmal eines Auftrags durch Mitarbeiter des Handelsplatzbetreibers geändert wird. Dies umfasst auch den Fall, dass bei einem Mitglied, Teilnehmer des Handelsplatzes IT-Probleme aufgetreten sind und dessen Aufträge dringend storniert werden müssen.</p> <p>Änderung des Status auf Initiative des Mitglieds, Teilnehmers des Handelsplatzes: umfasst die Aktivierung und Deaktivierung von Aufträgen.</p> <p>Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs</p> <p>Auf Initiative des Mitglieds, Teilnehmers des Handelsplatzes storniert: wenn ein Mitglied, ein Teilnehmer oder ein Kunde auf eigene Initiative beschließt, den von ihm zuvor eingegebenen Auftrag zu stornieren.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs storniert: Dies umfasst einen Schutzmechanismus, der für Wertpapierfirmen verfügbar ist, die Market-Making-Tätigkeiten gemäß Artikel 17 und Artikel 48 der Richtlinie 2014/65/EU ausführen.</p> <p>Zurückgewiesener Auftrag: ein eingegangener, jedoch vom Betreiber des</p>	<p>„REME“ – vom Mitglied oder Teilnehmer des Handelsplatzes ersetzt</p> <p>„REMA“ – infolge des Handelsbetriebs ersetzt (automatisch)</p> <p>„REMH“ – infolge des Handelsbetriebs ersetzt (menschliches Eingreifen)</p> <p>„CHME“ – Änderung des Status auf Initiative des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes</p> <p>„CHMO“ – Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs</p> <p>„CAME“ – auf Initiative des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes storniert</p> <p>„CAMO“ – infolge des Handelsbetriebs storniert</p> <p>„REMO“ – zurückgewiesener Auftrag</p> <p>„EXPI“ – abgelaufener Auftrag</p>
------------	---	---

		<p>Handelsplatzes zurückgewiesener Auftrag.</p> <p>Abgelaufener Auftrag: wenn der Auftrag nach Ablauf seiner Gültigkeitsdauer aus dem Orderbuch gelöscht wird.</p> <p>Teilweise ausgeführt: wenn der Auftrag nicht vollständig ausgeführt wird, so dass eine auszuführende Restmenge verbleibt.</p> <p>Vollständig ausgeführt: wenn keine Menge mehr zur Ausführung verbleibt.</p>	<p>„PARF“ – teilweise ausgeführt</p> <p>„FILL“ – vollständig ausgeführt</p> <p>{ ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p>
Abschnitt H – Art des Auftrags			
22	Auftragsart	Gibt die Art des Auftrags an, der dem Handelsplatz gemäß dessen Spezifikationen übermittelt wird.	{ ALPHANUM-50}
23	Klassifizierung der Auftragsart	<p>Klassifizierung des Auftrags nach zwei allgemeinen Auftragsarten. Limit-Order: wenn der Auftrag ausführbar ist und</p> <p>Stop-Order: wenn der Auftrag nur bei Eintreten eines vorab festgelegten Preisereignisses ausführbar wird</p>	<p>„LMTO“ für Limit-Order oder</p> <p>„STOP“ für Stop-Order</p>
Abschnitt I – Preise			
24	Limitpreis	<p>Höchstpreis, zu dem ein Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu dem ein Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann.</p> <p>Spreadpreis bei einer Strategieorder. Dieser Wert kann negativ oder positiv sein.</p> <p>Für Aufträge ohne Limitpreis oder Aufträge, für die kein Preis festgesetzt ist, ist dieses Feld leer zu lassen.</p> <p>Bei einer Wandelanleihe ist in diesem Feld der tatsächliche Preis (Clean Price oder Dirty Price) für den Auftrag anzugeben.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
25	Weiterer Limitpreis	Jeder andere Limitpreis, der für den Auftrag gelten kann. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.</p> <p>{DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
26	Stop-Preis	<p>Der Preis, der erreicht werden muss, damit der Auftrag aktiv wird.</p> <p>Für Stop-Order, die durch Ereignisse ausgelöst werden, die nicht vom Preis des Finanzinstruments abhängig sind, ist in diesem Feld ein Stop-Preis gleich null</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, falls der Preis als</p>

		<p>einzugeben. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</p>	<p>Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird. {DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
27	Pegged-Limitpreis	<p>Höchstpreis, zu dem eine Pegged-Order als Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu dem eine Pegged-Order als Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird. Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben. {DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird. {DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>
28	Transaktionspreis	<p>Handelspreis der Transaktion, ggf. ohne Provision und aufgelaufene Zinsen. Bei Optionskontrakten ist dies die Prämie des Derivatekontrakts pro Basiswert oder Indexpunkt. Bei Spread Bets ist dies der Referenzpreis des direkten zugrundeliegenden Finanzinstruments. Bei Credit Default Swaps (CDS) ist dies der Kupon in Basispunkten. Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben. Wenn kein Preis anwendbar ist, ist in diesem Feld „NOAP“ anzugeben.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird {DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird {DECIMAL-18/17}, falls der Preis in Basispunkten ausgedrückt wird. „NOAP“</p>
29	Währung des Preises	<p>Währung, in der der Handelspreis des Finanzinstruments, auf das sich der Auftrag bezieht, ausgedrückt wird (in Fällen, in denen der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird).</p>	<p>{CURRENCYCODE_3}</p>
30	Währung von Leg 2	<p>Bei Multi-Currency- oder Cross-Currency-Swaps ist die Währung von Leg 2 die Währung, auf die Leg 2 des Kontrakts lautet. Bei Swaptions, bei denen der zugrundeliegende Swap mehrere Währungen umfasst, ist die Währung von Leg 2 die Währung, auf die Leg 2 des Swaps lautet. Dieses Feld muss nur bei Zins- und Währungsderivatkontrakten ausgefüllt werden.</p>	<p>{CURRENCYCODE_3}</p>
31	Preisnotierung	<p>Gibt an, ob der Preis als monetärer Wert, in Prozent, als Rendite oder in Basispunkten ausgedrückt wird.</p>	<p>„MONE“ – monetärer Wert „PERC“ – Prozent „YIEL“ – Rendite „BAPO“ – Basispunkte</p>
Abschnitt J – Auftragsanweisungen			
32	Kauf/Verkauf-	<p>Angabe, ob es sich bei dem Auftrag um</p>	<p>„BUYI“ – Kauf</p>

Indikator	<p>einen Kauf oder einen Verkauf handelt.</p> <p>Bei Optionen und Swaptions ist der Käufer die Gegenpartei, die das Recht zur Ausübung der Option innehat, und der Verkäufer die Gegenpartei, die die Option verkauft und eine Prämie erhält.</p> <p>Bei Futures und Forwards, die sich nicht auf Währungen beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die das Instrument kauft, und der Verkäufer die Gegenpartei, die das Instrument verkauft.</p> <p>Bei Swaps, die sich auf Wertpapiere beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die das Risiko der Preisbewegung des zugrundeliegenden Wertpapiers übernimmt und den Wertpapierbetrag erhält. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die den Wertpapierbetrag zahlt.</p> <p>Bei Swaps, die sich auf Zinssätze oder Inflationsindizes beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die den Festzins zahlt. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die den Festzins erhält. Bei Basisswaps (Float-to-Float-Zinsswaps) ist der Käufer die Gegenpartei, die den Spread zahlt, und der Verkäufer die Gegenpartei, die den Spread erhält.</p> <p>Bei Swaps und Forwards, die sich auf Währungen beziehen, und bei Cross Currency Swaps ist der Käufer die Gegenpartei, welche die Währung erhält, die bei einer alphabetischen Sortierung nach den ISO 4217-Codes an erster Stelle steht, und der Verkäufer die Gegenpartei, die diese Währung liefert.</p> <p>Bei Swaps, die sich auf Dividenden beziehen, ist der Käufer die Gegenpartei, die die äquivalenten tatsächlichen Dividendenzahlungen erhält. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die die Dividende zahlt und den Festzins erhält.</p> <p>Bei derivativen Finanzinstrumenten zur Übertragung des Kreditrisikos, mit Ausnahme von Optionen und Swaptions, ist der Käufer die Gegenpartei, die diese Absicherung kauft. Der Verkäufer ist die Gegenpartei, die diese Absicherung verkauft.</p> <p>Bei Warenderivat- oder Emissionszertifikatderivat-Kontrakten ist der Käufer die Gegenpartei, die die angegebene Ware oder das angegeben Emissionszertifikat erhält, und der Verkäufer die Gegenpartei, die diese Ware/dieses Emissionszertifikat liefert.</p> <p>Bei Zinstermingeschäften (Forward Rate Agreements) ist der Käufer die Gegenpartei, die den Festzins zahlt, und</p>	„SELL“ – Verkauf
-----------	---	------------------

		<p>der Verkäufer die Gegenpartei, die den Festzins erhält.</p> <p>Bei einer Erhöhung des Nominalwerts entspricht der Käufer dem Erwerber des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts, und der Verkäufer entspricht dem Veräußerer des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts.</p> <p>Bei einer Verringerung des Nominalwerts entspricht der Käufer dem Veräußerer des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts, und der Verkäufer dem Erwerber des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts.</p>	
33	Auftragsstatus	<p>Zur Identifizierung von Aufträgen, die aktiv/inaktiv/ausgesetzt, verbindlich/indikativ (nur Offerten zugewiesen)/implizit/weitergeleitet sind.</p> <p>Aktiv – nicht Offerten zugewiesene Aufträge, die ausführbar sind.</p> <p>Inaktiv – nicht Offerten zugewiesene Aufträge, die nicht ausführbar sind.</p> <p>Verbindlich/Indikativ – nur Offerten zugewiesen. Indikative Offerten bedeuten, dass sie sichtbar sind, aber nicht ausgeführt werden können. An einigen Handelsplätzen sind hierin Bezugsrechte eingeschlossen. Verbindliche Offerten können ausgeführt werden.</p> <p>Implizit – für Strategieorders, die von der Implied in- oder Implied out-Funktionalität abgeleitet werden.</p> <p>Weitergeleitet – für Aufträge, die vom Handelsplatz an andere Handelsplätze weitergeleitet werden.</p>	<p>„ACTI“ – aktiv oder „INAC“ – inaktiv oder „FIRM“ – verbindliche Offerten oder „INDI“ – indikative Offerten oder „IMPL“ – implizierte Strategieorders oder „ROUT“ – weitergeleitete Aufträge</p> <p>Treffen mehrere Möglichkeiten zu, sind diese hier durch Kommata getrennt anzugeben.</p>
34	Mengennotierung	Gibt an, ob die angegebene Menge als Anzahl der Einheiten, als Nominalwert oder als monetärer Wert ausgedrückt wird.	<p>„UNIT“ – Anzahl der Einheiten „NOML“ – Nominalwert „MONE“ – monetärer Wert</p>
35	Währung der Menge	<p>Währung, in der die Menge ausgedrückt wird.</p> <p>Nur anzugeben, wenn die Menge als Nominalwert oder monetärer Wert ausgedrückt wird.</p>	{ CURRENCYCODE_3 }
36	Anfangsmenge	<p>Die Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments oder die Anzahl der Derivatekontrakte im Auftrag.</p> <p>Der Nominalwert oder der monetäre Wert des Finanzinstruments.</p> <p>Für Spread Bets entspricht die Menge des monetären Werts der Wette pro Punkt der Kursbewegung beim zugrundeliegenden Finanzinstrument.</p> <p>Bei einer Erhöhung oder Verringerung des Nennwerts des Derivatekontrakts gibt</p>	<p>{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird</p> <p>{DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird</p>

		diese Zahl den absoluten Wert der Veränderung wider und ist als positive Zahl auszudrücken. Für Credit Default Swaps ist die Menge der Nominalbetrag, für den die Absicherung erworben oder veräußert wird.	
37	Restmenge einschließlich nicht sichtbarer Teil	Die Gesamtmenge, die nach einer teilweisen Ausführung oder bei einem anderen Ereignis, das sich auf den Auftrag auswirkt, im Orderbuch verbleibt. Bei einer teilweisen Ausführung des Auftrags ist dies die nach dieser teilweisen Ausführung insgesamt verbleibende Menge. Bei der Eingabe eines Auftrags hat dieser Wert der Anfangsmenge zu entsprechen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
38	Angezeigte Menge	Die im Orderbuch sichtbare Menge (im Gegensatz zur nicht sichtbaren Menge)	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
39	Gehandelte Menge	Wenn es sich um eine teilweise oder vollständige Ausführung handelt, ist in diesem Feld die ausgeführte Menge anzugeben.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
40	Minimum Acceptable Quantity (MAQ)	Die akzeptierte kleinste Menge für einen auszuführenden Auftrag, die sich aus mehreren teilweisen Ausführungen zusammensetzen kann und normalerweise nur für nicht persistente Auftragsarten gilt. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
41	Minimum Executable Size (MES)	Die Mindestausführungsgröße einer einzelnen potenziellen Ausführung. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird
42	MES nur erste Ausführung	Gibt an, ob die MES nur für die erste Ausführung relevant ist. Wenn kein Eintrag in Feld 41 erfolgt, kann auch dieses Feld leer bleiben.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
43	Kennzeichen für nur passiv	Gibt an, ob der Auftrag mit einem Merkmal/Kennzeichen an den Handelsplatz übermittelt wird, das festlegt, dass der Auftrag nicht sofort gegen sichtbare Gegenaufträge ausgeführt werden soll.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
44	Kennzeichen für passiv oder	Gibt bei der teilweisen oder vollständigen Auftragsausführung an, ob der Auftrag	„PASV“ – passiv oder

	aggressiv	bereits im Orderbuch vorhanden war und der Liquiditätszufuhr dient (passiv) oder ob der Auftrag den Handel auslöste und somit Liquidität abschöpfte (aggressiv). Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	„AGRE“ – aggressiv
45	Self-Execution Prevention	Gibt an, ob der Auftrag mit Kriterien zur Verhinderung der Selbstaussführung eingegeben wurde, damit er nicht gegen einen Auftrag auf der Gegenseite des Buchs ausführbar ist, der vom selben Mitglied oder Teilnehmer eingegeben wurde.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
46	Identifikationscode für Strategieorder	Ein alphanumerischer Code, mit dem alle verbundenen Aufträge, die Teil einer Strategie gemäß Artikel 7 Absatz 2 sind, verknüpft werden.	{ALPHANUM-50}
47	Weiterleitungsstrategie	Die anwendbare Weiterleitungsstrategie gemäß der Spezifikation durch den Handelsplatz. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{ALPHANUM-50}
48	Vom Handelsplatz vergebener Transaktionsidentifikationscode	Alphanumerischer Code, den der Handelsplatz der Transaktion gemäß Artikel 12 der Delegierten Verordnung (EU) der Kommission über die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente ³ zuweist. Der vom Handelsplatz vergebene Transaktionsidentifikationscode muss für jeden Segment MIC nach ISO 10383 und jeden Handelstag eindeutig, konsistent und persistent sein. Verwendet der Handelsplatz keine Segment MICs, muss der Transaktionsidentifikationscode für jeden Operating MIC und Handelstag eindeutig, konsistent und persistent sein. Die Komponenten des Transaktionsidentifikationscodes dürfen die Identität der Gegenparteien der Transaktion, für die der Code geführt wird, nicht offenbaren.	{ALPHANUM-52}
Abschnitt K – Handelsphasen, indikativer Auktionspreis und indikatives Auktionsvolumen			
49	Handelsphasen	Die Bezeichnung der verschiedenen Handelsphasen, während deren ein Auftrag im Orderbuch vorhanden ist, einschließlich Handelseinstellungen, Notfallsicherungen und Aussetzungen.	{ALPHANUM-50}
50	Indikativer Auktionspreis	Der Preis, zu dem jede Auktion in Bezug auf das Finanzinstrument, für das ein oder mehrere Aufträge platziert wurden, auszugleichen ist.	{DECIMAL-18/5}, falls der Preis als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird. Wenn der Preis als monetärer Wert

³ [Bitte vollständigen Titel des Rechtsakts einfügen] (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

			ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben. {DECIMAL-11/10}, falls der Preis als Prozentsatz oder Rendite ausgedrückt wird.
51	Indikatives Auktionsvolumen	Das Volumen (Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments), das zum indikativen Auktionspreis in Feld 50 ausgeführt werden kann, falls die Auktion zu genau diesem Zeitpunkt enden würde	{DECIMAL-18/17}, falls die Menge als Anzahl der Einheiten ausgedrückt wird {DECIMAL-18/5}, falls die Menge als monetärer Wert oder als Nominalwert ausgedrückt wird