



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 23. August 2016
(OR. en)

11747/16
ADD 1

EF 255
ECOFIN 762
DELECT 171

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	22. August 2016
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2016) 4478 final ANNEXES 1 to 2
Betr.:	ANHÄNGE zur DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) Nr. .../. DER KOMMISSION zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der organisatorischen Anforderungen an Wertpapierfirmen, die algorithmischen Handel betreiben

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 4478 final ANNEXES 1 to 2.

Anl.: C(2016) 4478 final ANNEXES 1 to 2



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 19.7.2016
C(2016) 4478 final

ANNEXES 1 to 2

ANHÄNGE

zur

DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) Nr. .../.. DER KOMMISSION

zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der organisatorischen Anforderungen an Wertpapierfirmen, die algorithmischen Handel betreiben

ANHÄNGE

zur

DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) Nr. .../.. DER KOMMISSION

zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der organisatorischen Anforderungen an Wertpapierfirmen, die algorithmischen Handel betreiben

Anhang I

Von Wertpapierfirmen bei der Selbstbeurteilung gemäß Artikel 9 Absatz 1 zu berücksichtigende Kriterien

1. Bei der Beurteilung der Art ihrer Geschäftstätigkeit berücksichtigen Wertpapierfirmen folgende Kriterien, sofern anwendbar:
 - a) den aufsichtsrechtlichen Status der Firma und, sofern vorhanden, ihrer DEA-Kunden, einschließlich der aufsichtsrechtlichen Anforderungen, denen sie als Wertpapierfirma nach der Richtlinie 2014/65/EU und anderen relevanten aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegt;
 - b) die Rollen der Firma auf dem Markt, u. a., ob sie als Market-Maker auftritt und ob sie Kundenaufträge ausführt oder nur für eigene Rechnung handelt;
 - c) den Automatisierungsgrad des Handels und sonstiger Prozesse oder Tätigkeiten der Firma;
 - d) die Arten und den aufsichtsrechtlichen Status der Instrumente, Produkte und Anlageklassen, mit denen die Firma handelt;
 - e) die Arten von Strategien, die die Firma verwendet, und die Risiken, die diese Strategien für das Risikomanagement der Firma selbst und für das faire und ordnungsgemäße Funktionieren der Märkte mit sich bringen; insbesondere berücksichtigt die Firma die Art dieser Strategien, beispielsweise Market-Making oder Arbitrage, und ob es sich um langfristige, kurzfristige, direktionale oder nicht-direktionale Strategien handelt;
 - f) die Latenzempfindlichkeit der Strategien und Handelstätigkeiten der Firma;
 - g) die Art und der aufsichtsrechtliche Status der Handelsplätze und anderen Liquiditätspools, zu denen ein Zugang besteht, insbesondere, ob die Handelstätigkeit auf unregulierten intransparenten „Dark Pools“, regulierten transparenten „Lit Pools“ oder Handelsplätzen für Over-the-Counter-Handel (OTC) ausgeübt werden;

- h) die Konnektivitätslösungen der Firma und ob sie als Mitglied, als DEA-Kunde oder als DEA-Bereitsteller Zugang zu den Handelsplätzen hat;
 - i) der Umfang, in dem die Firma die Entwicklung und Pflege ihrer Handelsalgorithmen oder Handelssysteme Dritten anvertraut hat und ob diese Algorithmen oder Handelssysteme von der Firma selbst oder in Zusammenarbeit mit einem Dritten entwickelt oder von einem Dritten gekauft oder an diesen ausgelagert wurden;
 - j) die Eigentumsverhältnisse und die Unternehmensführung der Firma, ihre organisatorische und operative Struktur und ob es sich um einen Partner, ein Tochterunternehmen, ein börsennotiertes Unternehmen oder eine andere Unternehmensform handelt;
 - k) Aufbau und Organisation von Risikomanagement, Compliance und Audits der Firma;
 - l) das Gründungsdatum der Firma sowie die Erfahrung und Kompetenz ihrer Mitarbeiter, ggf. die bislang erst kurze Bestandsdauer der Firma.
2. Bei der Beurteilung des Umfangs ihrer Geschäftstätigkeit berücksichtigen Wertpapierfirmen folgende Kriterien, sofern anwendbar:
- a) die Anzahl der parallel betriebenen Algorithmen und Strategien;
 - b) die Anzahl der gehandelten einzelnen Instrumente, Produkte und Anlageklassen;
 - c) die Anzahl der Handelsabteilungen und der verwendeten eindeutigen Kennungen der für die Auftragsausführung verantwortlichen natürlichen Personen und Algorithmen;
 - d) die Kapazitäten für Mitteilungsvolumina, insbesondere die Anzahl der eingereichten, geänderten, stornierten und ausgeführten Aufträge;
 - e) der monetäre Wert ihrer Brutto- und Nettopositionen für Innertag- und Übernachtpositionen;
 - f) die Anzahl der Märkte, zu denen die Firma entweder als Mitglied oder Teilnehmer oder per DEA Zugang hat;
 - g) die Anzahl und Größe der Kunden der Firma, insbesondere ihrer DEA-Kunden;
 - h) die Anzahl der Kollokations- oder Proximity-Hosting-Standorte, mit denen die Firma verbunden ist;
 - i) die Datenübermittlungskapazität der Konnektivitätsinfrastruktur der Firma;
 - j) die Anzahl der Clearingmitglieder oder CCP-Mitgliedschaften der Firma;
 - k) die Größe der Firma im Hinblick auf die Anzahl ihrer Händler und ihrer Front-Office-, Middle-Office- und Back-Office-Mitarbeiter in Vollzeitäquivalenten;

- l) die Anzahl der physischen Standorte der Firma;
 - m) die Anzahl der Länder und Regionen, in denen die Firma Handelstätigkeiten ausübt;
 - n) die Jahreseinkünfte und Jahresgewinne der Firma.
3. Bei der Beurteilung der Komplexität ihrer Geschäftstätigkeit berücksichtigen Wertpapierfirmen folgende Kriterien, sofern anwendbar:
- a) die Art der von der Firma oder ihren Kunden verfolgten Strategien, sofern diese Strategien der Firma bekannt sind, und insbesondere, ob aufgrund dieser Strategien durch Algorithmen Aufträge ausgelöst werden, die sich auf verwandte Instrumente beziehen oder an mehreren Handelsplätzen oder Liquiditätspools ausgeführt werden;
 - b) die Algorithmen der Firma im Hinblick auf ihren Code, ihre Eingangsdaten, ihre wechselseitigen Abhängigkeiten, die in ihnen enthaltenen Ausnahmen von Regeln oder sonstige Merkmale;
 - c) die Handelssysteme der Firma im Hinblick auf deren Vielfalt und den Umfang, in dem die Firma ihre Handelssysteme nach eigenem Ermessen einrichten, anpassen, testen und überprüfen kann;
 - d) die Struktur der Firma im Hinblick auf Eigentumsverhältnisse und Unternehmensführung sowie ihre organisatorischen, operativen, technischen, physischen oder geografischen Gegebenheiten;
 - e) die Vielfalt der Konnektivitäts-, Technologie- oder Clearing-Lösungen der Firma;
 - f) die Vielfalt der physischen Infrastrukturen, die die Firma für den Handel verwendet;
 - g) der Umfang, in dem die Firma Funktionen ausgelagert hat oder anbietet, insbesondere der Umfang ausgelagerter Schlüsselfunktionen;
 - h) die Bereitstellung oder Nutzung direkter elektronischer Zugänge durch die Firma, seien es direkte Marktzugänge oder geförderte Zugänge, und die Bedingungen, zu denen sie ihren Kunden einen direkten elektronischen Zugang anbietet und
 - i) die Geschwindigkeit des von der Firma oder ihren Kunden betriebenen Handels.

Anhang II

Inhalt und Format der Auftragsaufzeichnungen gemäß Artikel 28

Tabelle 1

Legende zu den Tabellen 2 und 3

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM- n}	Bis zu n alphanumeris- che Zeichen	Freitextfeld
{CURRENCYC ODE_3}	3 alphanumeris- che Zeichen	Währungscode aus 3 Buchstaben gemäß den Währungs-codes nach ISO 4217
{DATE_TIME_ FORMAT}	Datums- und Zeitformat nach ISO 8601	<p>Datum und Uhrzeit in folgendem Format: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dzzzzzzZ</p> <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.dzzzzzz“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde - Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit) <p>Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben.</p>
{DECIMAL- n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen insgesamt, wovon bis zu m Stellen Nachkommast- ellen sein können	<p>Numerisches Feld für positive und negative Werte:</p> <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	Code für die Identifizierung von Handelsplätzen gemäß ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 alphanumerische Zeichen	Kennung, die in Artikel 6 und Anhang II der [technischen Regulierungsstandards 22 über Meldepflichten gemäß Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014] festgelegt ist

Tabelle 2

Informationen über jede ursprüngliche Entscheidung über den Handel und eingehende Kundenaufträge

Nr.	Feld	Beschreibung	Standards und Formate
1	Vorname(n) des Kunden	<p>Vollständige(r) Vorname(n) des Kunden. Bei mehreren Vornamen sind sämtliche Namen durch Kommata getrennt in diesem Feld anzugeben.</p> <p>Bei Angabe der Rechtsträgerkennung (LEI) ist dieses Feld leer zu lassen.</p>	{ALPHANUM-140}
2	Nachname(n) des Kunden	<p>Vollständige(r) Nachname(n) des Kunden. Bei mehreren Nachnamen sind sämtliche Namen durch Kommata getrennt in diesem Feld anzugeben.</p> <p>Bei Angabe der Rechtsträgerkennung (LEI) ist dieses Feld leer zu lassen.</p>	{ALPHANUM-140}
3	Kundenidentifikationscode	<p>Code zur Identifikation des Kunden der Wertpapierfirma. Im Falle eines direkten elektronischen Zugangs ist der Code des DEA-Nutzers anzugeben.</p> <p>Wenn der Kunde eine juristische Person ist, ist der LEI-Code des Kunden zu verwenden.</p> <p>Ist der Kunde keine juristische Person, ist die {NATIONAL_ID} zu verwenden.</p> <p>Bei Sammelaufträgen ist das Kennzeichen „AGGR“ zu</p>	<p>{LEI}</p> <p>{NATIONAL_ID}</p> <p>„AGGR“ – Sammelaufträge</p> <p>„PNAL“ – Zuweisung ausstehend</p>

		<p>verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission¹).</p> <p>Wenn die Zuweisung des Auftrags noch aussteht, ist das Kennzeichen „PNAL“ zu verwenden (siehe Artikel 2 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission²).</p> <p>Dieses Feld ist nur dann leer zu lassen, wenn die Wertpapierfirma keinen Kunden hat.</p>	
4	Vorname(n) der im Auftrag des Kunden tätig werdenden Person	<p>In dieses Feld sind alle Vornamen der Person einzutragen, die im Auftrag des Kunden tätig wird.</p> <p>Bei mehreren Vornamen sind sämtliche Namen durch Kommata getrennt in diesem Feld anzugeben.</p>	{ALPHANUM-140}
5	Nachname(n) der im Auftrag des Kunden tätig werdenden Person	<p>In dieses Feld sind alle Nachnamen der Person einzutragen, die im Auftrag des Kunden tätig wird. Bei mehreren Nachnamen sind sämtliche Nachnamen durch Kommata getrennt in diesem Feld anzugeben.</p>	{ALPHANUM-140}
6	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	<p>Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus innerhalb der Wertpapierfirma, die oder der für die Anlageentscheidung verantwortlich ist (siehe</p>	<p>{NATIONAL_ID} – Natürliche Person</p> <p>{ALPHANUM-50} – Algorithmus</p>

¹ Delegierte Verordnung (EU) .../... 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 (ABl.....)

² Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom... 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 (ABl.....) [Bitte den vollständigen Titel des Rechtsakts einfügen] (Abl. [...] vom [...], S. [...]).

		<p>Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission³.</p> <p>War eine natürliche Person 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 Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission⁴ auszufüllen.</p> <p>Dieses Feld ist leer zu lassen, wenn die Anlageentscheidung nicht von einer Person oder einem Algorithmus innerhalb der Wertpapierfirma getroffen wurde.</p>	
7	Ursprüngliche Auftragsbezeichnung	Der zur Kennzeichnung des vom Kunden eingegangenen oder durch die Wertpapierfirma erzeugten Auftrags verwendete Code, bevor der Auftrag verarbeitet und beim Handelsplatz oder der Wertpapierfirma eingereicht wird.	{ALPHANUM-50}
8	Kauf/Verkauf-Indikator	Angabe, ob es sich bei dem Auftrag um einen Kauf oder einen Verkauf handelt. Bei Optionen und Swaptions	„BUYI“ – Kauf „SELL“ – Verkauf

³ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

⁴ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		<p>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 ist 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 Basiswaps (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</p>	
--	--	---	--

		<p>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 angegebene 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 der Verkäufer die Gegenpartei, die den Festzins erhält.</p> <p>Bei einer Erhöhung des Nominalwerts entspricht der</p>	
--	--	---	--

		<p>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 entspricht dem Erwerber des Finanzinstruments innerhalb des ursprünglichen Geschäfts.</p>	
9	Identifikationscode des Finanzinstruments	Eindeutige Kennung des Finanzinstruments	{ISIN}
10	Preis	<p>Limitpreis des Auftrags, ggf. ohne Provision und aufgelaufene Zinsen.</p> <p>Für Stop-Order ist dies der Stop-Preis des Auftrags.</p> <p>Bei Optionskontrakten ist dies die Prämie des Derivatkontrakts pro Basiswert oder Indexpunkt.</p> <p>Bei Spreadbets ist dies der Referenzpreis des direkten zugrundeliegenden Finanzinstruments.</p> <p>Bei Credit Default Swaps (CDS) ist dies der Kupon in Basispunkten.</p> <p>Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben.</p> <p>Wenn kein Preis anwendbar ist, ist in diesem Feld</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird</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> <p>„PNDG“, falls der Preis nicht verfügbar ist</p> <p>„NOAP“ falls der Preis nicht anwendbar ist</p>

		<p>„NOAP“ anzugeben.</p> <p>Wenn der Preis momentan nicht verfügbar, aber „in der Schwebe“ ist, lautet der Wert „PNDG“.</p> <p>Bei einem vereinbarten Preis von null ist der Preis mit null anzugeben.</p> <p>Die Werte werden nicht gerundet und nicht abgeschnitten.</p>	
11	Preisnotierung	Gibt an, ob der Preis und der Ausführungspreis als monetärer Wert, in Prozent, als Rendite oder in Basispunkten ausgedrückt werden.	<p>„MONE“ – monetärer Wert</p> <p>„PERC“ – Prozent</p> <p>„YIEL“ – Rendite</p> <p>„BAPO“ – Basispunkte</p>
12	Preismultiplikator	<p>Anzahl der Einheiten des Basisinstruments, die von einem einzelnen Derivatkontrakt erfasst wird.</p> <p>Monetärer Wert eines einzelnen Swapkontrakts, wenn im Feld „Menge“ die Anzahl der Swapkontrakte im Geschäft angegeben ist. Bei Future oder Option auf einen Index: Betrag je Indexpunkt.</p> <p>Bei Spreadbets die Bewegung des Kurses des Basisinstruments, auf dem der Spreadbet beruht.</p> <p>Die Angaben in diesem Feld müssen mit den in den Feldern 10 und 26 angegebenen Werten übereinstimmen.</p>	<p>{DECIMAL – 18/17}</p> <p>„1“ bei nichtderivativen Finanzinstrumenten, die nicht über Kontrakte gehandelt werden.</p>
13	Währung des Preises	Währung, in der der Handelspreis des Finanzinstruments, auf das sich der Auftrag bezieht, ausgedrückt wird (in Fällen, in denen der Preis als monetärer	{CURRENCYCODE_3}

		Wert ausgedrückt wird).	
14	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.</p> <p>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.</p> <p>Dieses Feld muss nur bei Zins- und Währungsderivatkontrakten ausgefüllt werden.</p>	{CURRENCYCODE_3}
15	Code des Basisinstruments	<p>ISIN-Code des Basisinstruments</p> <p>Bei ADR, GDR und ähnlichen Instrumenten Angabe des ISIN-Codes des Finanzinstruments, auf dem diese Instrumente beruhen.</p> <p>Bei Wandelschuldverschreibungen Angabe des ISIN-Codes des Instruments, in das die Wandelschuldverschreibung umgewandelt werden kann.</p> <p>Bei Derivaten oder anderen Finanzinstrumenten, denen ein Basisinstrument zugrundeliegt, der ISIN-Code des Basisinstruments, sofern dieses an einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Handelt es sich beim Basiswert um eine Aktiendividende, Angabe des ISIN-Codes der betreffenden Aktie, die den Anspruch auf die zugrundeliegenden</p>	{ISIN}

		<p>Dividenden begründet.</p> <p>Bei Credit Default Swaps Angabe der ISIN der Referenzverbindlichkeit.</p> <p>Wenn der Basiswert ein Index ist und eine ISIN hat, Angabe des ISIN-Codes für diesen Index.</p> <p>Wenn es sich beim Basiswert um einen Korb handelt, Angabe des ISIN-Codes für jeden Bestandteil des Korbes, der an einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Dieses Feld ist so oft zu melden, bis alle im Korb enthaltenen Instrumente aufgeführt sind.</p>	
16	Art der Option	<p>Angabe, ob es sich beim Derivatkontrakt um eine Call-Option (Berechtigung zum Erwerb eines spezifischen Basisvermögenswerts) oder eine Put-Option (Berechtigung zum Verkauf eines spezifischen Basisvermögenswerts) handelt oder ob zum Zeitpunkt der Orderplatzierung nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt. Im Fall von Swaptions gilt Folgendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> - „PUTO“, wenn es sich um eine Receiver Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz erhält. - „CALL“, wenn es sich um eine Payer Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, 	<p>„PUTO“ – Put-Option „CALL“ – Call-Option „OTHR“ – wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt</p>

		<p>in dem er einen festen Zinssatz zahlt.</p> <p>Im Fall von Caps und Floors gilt Folgendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> - „PUTO“ im Falle eines Floors. - „CALL“ im Falle eines Caps. <p>Das Feld gilt nur für Derivate, die Optionen oder Optionsscheine sind.</p>	
17	Ausübungspreis	<p>Festgelegter Preis, bei dem der Inhaber das Basisinstrument kaufen oder verkaufen muss, oder Angabe, dass der Preis zum Zeitpunkt der Orderplatzierung nicht bestimmt werden kann.</p> <p>Das Feld muss nur für Optionen oder Optionsscheine ausgefüllt werden, bei denen der Ausübungspreis zum Zeitpunkt der Orderplatzierung festgestellt werden kann.</p> <p>Wenn kein Ausübungspreis zutrifft, ist dieses Feld nicht auszufüllen.</p>	<p>{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird</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> <p>„PNDG“, falls der Preis nicht verfügbar ist</p>
18	Währung des Ausübungspreises	Währung des Ausübungspreises	{CURRENCYCODE_3}
19	Zahlung bei Abschluss	<p>Monetärer Wert jeglicher Zahlungen, die der Verkäufer bei Abschluss erhalten oder geleistet hat, in Basispunkten.</p> <p>Erhält der Verkäufer die Zahlung bei Abschluss, ist der angegebene Wert positiv. Leistet der Verkäufer die Zahlung bei Abschluss, ist der angegebene Wert negativ.</p>	{DECIMAL-18/5}

		Bei einer Erhöhung oder Verringerung des Nennwerts des Derivatkontrakts gibt diese Zahl den absoluten Wert der Veränderung wieder und ist als positive Zahl auszudrücken.	
20	Art der Lieferung	Angabe, ob das Geschäft effektiv geliefert oder in bar abgerechnet wird. Wenn die Lieferart zum Zeitpunkt der Orderplatzierung nicht bestimmt werden kann, ist der Wert „OPTL“ anzugeben. Das Feld ist nur für Derivate auszufüllen.	„PHYS“ – effektive Lieferung „CASH“ – Abrechnung in bar „OPTL“ – optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten
21	Art der Option (mögliche Ausübung)	Angabe, ob die Option ausschließlich zu einem bestimmten Termin (europäische, asiatische Option), zu verschiedenen im Voraus festgelegten Terminen (Bermuda-Option) oder jederzeit vor ihrem Verfallsdatum (amerikanische Option) ausgeübt werden kann. Dieses Feld gilt nur für Optionen.	„EURO“ – Europäische Option „AMER“ – Amerikanische Option „ASIA“ – Asiatische Option „BERM“ – Bermuda-Option „OTHR“ – Sonstige Option
22	Fälligkeitstermin	Datum der Fälligkeit des Finanzinstruments. Dieses Feld gilt nur für Schuldtitel mit festgelegter Fälligkeit.	{DATEFORMAT}
23	Ablaufdatum	Ablaufdatum des gemeldeten Finanzinstruments. Das Feld gilt nur für Derivate mit festgelegtem Ablaufdatum.	{DATEFORMAT}
24	Währung der Menge	Währung, in der die Menge	{CURRENCYCODE_3}

		<p>ausgedrückt wird.</p> <p>Das Feld gilt nur, wenn die Menge als Nominalwert oder monetärer Wert ausgedrückt wird.</p>	
25	Mengennotierung	<p>Angabe, ob die angegebene Menge als Anzahl der Einheiten, als Nominalwert oder als monetärer Wert ausgedrückt wird.</p>	<p>„UNIT“ – Anzahl der Einheiten</p> <p>„NOML“ – Nominalwert</p> <p>„MONE“ – monetärer Wert</p>
26	Anfangsmenge	<p>Die Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments oder die Anzahl der Derivatkontrakte im Auftrag.</p> <p>Der Nominalwert oder der monetäre Wert des Finanzinstruments.</p> <p>Bei Spreadbets entspricht die Menge dem monetären Wert der Wette pro Punkt der Kursbewegung beim zugrundeliegenden Finanzinstrument.</p> <p>Bei einer Erhöhung oder Verringerung des Nennwerts des Derivatkontrakts gibt diese Zahl den absoluten Wert der Veränderung wieder und ist als positive Zahl auszudrücken.</p> <p>Für Credit Default Swaps ist die Menge der Nominalbetrag, für den die Absicherung erworben oder veräußert wird.</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>
27	Datum und Uhrzeit	<p>Das genaue Datum und die genaue Uhrzeit des Auftragseingangs oder das genaue Datum und die genaue Uhrzeit der Entscheidung über den Handel. Wenn anwendbar, wird dieses Feld</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Wenn anwendbar, ist die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ gemäß Tabelle 2 des Anhangs der</p>

		gemäß Artikel 3 und Tabelle 2 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission ⁵ ausgefüllt.	Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission ⁶ zu bestimmen.
28	Weitere Informationen vom Kunden	Etwaige Anweisungen, Parameter, Bedingungen und andere Einzelheiten des Auftrags, die der Kunde an die Wertpapierfirma übermittelt hat.	Freitext

⁵ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

⁶ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

Tabelle 3

Informationen mit Bezug auf ausgehende und ausgeführte Aufträge

Nr.	Feld/Inhalt	Beschreibung	Format
1	Kauf/Verkauf-Indikator	Zeigt an, ob ein Kauf- oder Verkaufsauftrag vorliegt, wie anhand der Beschreibung von Feld 8 der Tabelle 2 ermittelt.	„BUYI“ – Kauf „SELL“ – Verkauf
2	Handelskapazität	Gibt an, ob der Auftragseingang daraus resultiert, dass das Mitglied, der Teilnehmer oder der Kunde 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
3	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 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission ⁷ an einen Handelsplatz weitergeleitet wird.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
4	Ausführung innerhalb der Firma	Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus innerhalb der Wertpapierfirma, die oder der für die	{NATIONAL_ID} – Natürliche Person

⁷ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards bezüglich der Daten, die Ausführungsplätze zur Qualität der Ausführung von Geschäften veröffentlichen müssen (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		<p>Ausführung des aus dem Auftrag resultierenden Geschäfts verantwortlich ist (siehe Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission)⁸.</p> <p>Ist für die Ausführung des Geschäfts eine natürliche Person verantwortlich, ist die Person mit ihrer {NATIONAL_ID} anzugeben.</p> <p>Ist ein Algorithmus für die Ausführung des Geschäfts verantwortlich, ist das Feld gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission⁹ auszufüllen.</p> <p>Wenn mehrere Personen oder eine Kombination von Personen und Algorithmen an der Ausführung des Geschäfts beteiligt sind, bestimmt die Wertpapierfirma den vorrangig verantwortlichen Händler oder Algorithmus (siehe Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission¹⁰) und trägt in dieses Feld die Kennung dieses Händlers oder Algorithmus ein.</p> <p>Dieses Feld gilt nur für ausgeführte Aufträge.</p>	{ALPHANUM-50} – Algorithmus
5	Der Identifikationscode des beim Handelsplatz oder einer anderen Wertpapierfirma eingereichten Auftrags	Der von der Wertpapierfirma intern zur Kennzeichnung des beim Handelsplatz oder einer anderen Wertpapierfirma eingereichten Auftrags verwendete Code, sofern er pro Handelstag und pro Finanzinstrument eindeutig ist.	{ALPHANUM-50}

⁸ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

⁹ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

¹⁰ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

6	Der bei der Einreichung bei einer anderen Wertpapierfirma oder einem Handelsplatz von dieser oder diesem vergebene Identifikationscode des Auftrags.	Wenn eine andere Wertpapierfirma oder ein Handelsplatz, bei der bzw. dem der Auftrag zur Ausführung eingereicht wurde, diesen durch einen alphanumerischen Code gekennzeichnet hat, dann ist dieser Code in dieses Feld einzutragen.	{ALPHANUM-50}
7	Identifikationscode des Auftragsempfängers	Der Code der Wertpapierfirma, an die der Auftrag übertragen wurde, oder der Code des Handelsplatzes, an den der Auftrag übertragen wurde.	Für Wertpapierfirmen: {LEI} Für Handelsplätze: {MIC}
8	Auftragsart	Gibt die Art des Auftrags an, der dem Handelsplatz gemäß dessen Spezifikationen übermittelt wird.	{ALPHANUM-50}
9	Limitpreis	Höchstpreis, zu dem ein Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu dem ein Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann. Spreadpreis bei einer Strategieorder. Dieser Wert kann negativ oder positiv sein. Für Aufträge ohne Limitpreis oder Aufträge, für die kein Preis festgesetzt ist, ist dieses Feld leer zu lassen. Bei einer Wandelanleihe ist in diesem Feld der tatsächliche Preis (Clean Price oder Dirty Price) für den Auftrag anzugeben. Wenn ein Auftrag ausgeführt wird, zeichnet die Wertpapierfirma auch den Preis auf, zu dem das Geschäft ausgeführt wurde.	{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.
10	Währung des Preises	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).	{CURRENCYCODE_3}

11	Preisnotierung	Gibt an, ob der Preis als monetärer Wert, in Prozent, als Rendite oder in Basispunkten ausgedrückt wird.	„MONE“ – monetärer Wert „PERC“ – Prozent „YIEL“ – Rendite „BAPO“ – Basispunkte
12	Weiterer Limitpreis	Jeder andere Limitpreis, der für den Auftrag gelten kann. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{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.
13	Stop-Preis	Der Preis, der erreicht werden muss, damit der Auftrag aktiv wird. 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 einzugeben. Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.	{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.
14	Pegged-Limitpreis	Höchstpreis, zu dem eine Pegged-Order als Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder Mindestpreis, zu	{DECIMAL-18/13}, falls der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.

		<p>dem eine Pegged-Order als Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann.</p> <p>Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</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>
15	Restmenge einschließlich nicht sichtbarer Teil	<p>Die Gesamtmenge, die nach einer teilweisen Ausführung oder bei einem anderen Ereignis, das sich auf den Auftrag auswirkt, im Orderbuch verbleibt.</p> <p>Bei einer teilweisen Ausführung des Auftrags ist dies die nach dieser teilweisen Ausführung insgesamt verbleibende Menge. Bei der Eingabe eines Auftrags entspricht dieser Wert der Anfangsmenge.</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>
16	Angezeigte Menge	<p>Die im Orderbuch sichtbare Menge (im Gegensatz zur nicht sichtbaren Menge).</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>
17	Gehandelte Menge	<p>Wenn es sich um eine teilweise oder vollständige Ausführung handelt, ist in diesem Feld die ausgeführte Menge anzugeben.</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>

18	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.
19	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.
20	MES nur erste Ausführung	Gibt an, ob die MES nur für die erste Ausführung relevant ist. Wenn kein Eintrag in Feld 19 erfolgt, kann auch dieses Feld leer bleiben.	„zutreffend“ „nicht zutreffend“
21	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“
22	Self-Execution Prevention	Gibt an, ob der Auftrag mit Kriterien zur Verhinderung der Selbstauführung 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“
23	Datum und Uhrzeit (Auftragseinreichung)	Genaues Datum und genaue Uhrzeit der Einreichung des Auftrags beim Handelsplatz oder bei einer anderen Wertpapierfirma.	{DATE_TIME_FORMAT} } Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Tabelle 2 des Anhangs der Delegierten

			Verordnung (EU) .../... der Kommission ¹¹ zu bestimmen.
24	Datum und Uhrzeit (Auftragseingang)	Genaues Datum und genaue Uhrzeit aller auftragsbezogenen Mitteilungen, die an den Handelsplatz oder die andere Wertpapierfirma übermittelt wurden oder vom Handelsplatz oder der anderen Wertpapierfirma eingingen.	{DATE_TIME_FORMAT} Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Tabelle 2 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission ¹² zu bestimmen.
25	Laufende Nummer	Jedes in Feld 26 aufgeführte Ereignis ist von der Wertpapierfirma durch positive Ganzzahlen in aufsteigender Reihenfolge zu identifizieren. Für jeden Ereignistyp darf nur eine laufende Nummer vergeben werden, diese muss über alle Ereignisse hinweg konsistent sein, von der Wertpapierfirma mit einem Zeitstempel versehen sein und für das Datum, an dem das Ereignis eintritt, fortbestehen.	{INTEGER-50}
26	Neuer Auftrag, Ändern des Auftrags, Stornieren des Auftrags, Zurückweisen des Auftrags, vollständige oder teilweise Ausführung	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. Vom Mitglied, Teilnehmer oder Kunden des Handelsplatzes ersetzt: wenn ein Mitglied, ein Teilnehmer oder ein Kunde des Handelsplatzes	„NEWO“ – neuer Auftrag „TRIG“ – ausgelöst „REME“ – vom Mitglied, Teilnehmer oder Kunden des Handelsplatzes ersetzt

¹¹ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

¹² Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		<p>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 oder Kunden des Handelsplatzes IT-Probleme aufgetreten sind und dessen Aufträge dringend storniert werden müssen.</p> <p>Änderung des Status auf Initiative des Mitglieds, Teilnehmers oder Kunden des Handelsplatzes: umfasst die Aktivierung und Deaktivierung von Aufträgen.</p> <p>Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs.</p> <p>Auf Initiative des Mitglieds,</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, Teilnehmers oder Kunden des Handelsplatzes</p> <p>„CHMO“ – Änderung des Status infolge des Handelsbetriebs</p> <p>„CAME“ – auf Initiative des Mitglieds oder Teilnehmers des</p>
--	--	--	--

		<p>Teilnehmers oder Kunden des Handelsplatzes storniert.</p> <p>Infolge des Handelsbetriebs storniert: Dies umfasst einen Schutzmechanismus, der für Wertpapierfirmen verfügbar ist, die gemäß den Artikeln 17 und 48 der Richtlinie 2014/65/EU in Verfolgung einer Market-Making-Strategie algorithmischen Handel betreiben.</p> <p>Zurückgewiesener Auftrag: ein eingegangener, vom Betreiber des Handelsplatzes aber 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>Handelsplatzes storniert</p> <p>„CAMO“ – infolge des Handelsbetriebs storniert</p> <p>„REMO“ – zurückgewiesener Auftrag</p> <p>„EXPI“ – abgelaufener Auftrag</p> <p>„PARF“ – teilweise ausgeführt</p> <p>„FILL“ – vollständig ausgeführt</p>
--	--	--	---

			{ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden.
27	Leerverkaufsindikator	<p>Ein von einer Wertpapierfirma in eigenem Namen oder im Namen eines Kunden abgeschlossener Leerverkauf gemäß Artikel 11 der [technischen Regulierungsstandards für Meldepflichten gemäß Artikel 26 MiFIR]¹³</p> <p>Führt eine Wertpapierfirma ein Geschäft im Namen eines verkaufenden Kunden aus und kann die Firma nach bestem Bemühen nicht bestimmen, ob es sich um ein Leerverkaufsgeschäft handelt, ist in diesem Feld „UNDI“ anzugeben.</p> <p>Handelt es sich bei dem Geschäft um einen übermittelten Auftrag, der die Voraussetzungen für eine Übermittlung gemäß Artikel 4 [der technischen Regulierungsstandards für Meldepflichten gemäß Artikel 26 MiFIR] erfüllt, nimmt die Empfängerfirma die Angaben in diesem Feld anhand der von der übermittelnden Firma erhaltenen Informationen in der Meldung der Empfängerfirma vor.</p> <p>Dieses Feld muss nur ausgefüllt werden, wenn das Instrument unter die Verordnung (EU) Nr. 236/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates¹⁴ fällt und der Verkäufer die Wertpapierfirma oder ein Kunde der Wertpapierfirma ist.</p>	<p>„SSHO“ – Leerverkauf ohne Ausnahme</p> <p>„SSEX“ – Leerverkauf mit Ausnahme</p> <p>„SELL“ – Kein Leerverkauf</p> <p>„UNDI“ – Information nicht verfügbar</p>

¹³ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für Transaktionsmeldungen an die zuständigen Behörden (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

¹⁴ Verordnung (EU) Nr. 236/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. März 2012 über Leerverkäufe und bestimmte Aspekte von Credit Default Swaps (ABl. L 86 vom 24.3.2012, S. 1).

		Dieses Feld gilt nur für ausgeführte Aufträge.	
28	Ausnahmeindikator	<p>Angabe, ob das Geschäft im Rahmen einer Ausnahme von den Vorhandelsanforderungen gemäß den Artikeln 4 und 9 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 ausgeführt wurde.</p> <p>Für Eigenkapitalinstrumente: „RFPT“ = Referenzpreisgeschäft „NLIQ“ = Ausgehandelte Geschäfte mit liquiden Finanzinstrumenten „OILQ“ = Ausgehandelte Geschäfte mit illiquiden Finanzinstrumenten „PRIQ“ = Ausgehandelte Geschäfte, auf die andere Bedingungen als der jeweils geltende Marktkurs des betreffenden Finanzinstruments anwendbar sind</p> <p>Für Nichteigenkapitalinstrumente: „SIZE“ = Geschäft, das über das typische Geschäftsvolumen hinausgeht „ILQD“ = Geschäft mit einem illiquiden Instrument</p> <p>Dieses Feld gilt nur für Aufträge, die an einem Handelsplatz im Rahmen einer Ausnahme von den Vorhandelsanforderungen ausgeführt wurden.</p>	<p>Geben Sie eines oder mehrere der folgenden Kennzeichen an:</p> <p>„RFPT“ = Referenzpreisgeschäft „NLIQ“ – Ausgehandelt (liquide) „OILQ“ – Ausgehandelt (illiquide) „PRIC“ – Ausgehandelt (Bedingungen) „SIZE“ – über typischem Volumen „ILQD“ – illiquides Instrument</p>
29	Weiterleitungsstrategie	<p>Die anwendbare Weiterleitungsstrategie gemäß der Spezifikation durch den Handelsplatz.</p> <p>Falls nicht relevant, Feld bitte leer lassen.</p>	{ALPHANUM-50}
30	Vom Handelsplatz vergebener Transaktionsidentifikationscode	Alphanumerischer Code, den der Handelsplatz der Transaktion gemäß Artikel 12 der [technischen] Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger Daten	{ALPHANUM-52}

		<p>über Aufträge für Finanzinstrumente]¹⁵ zuweist.</p> <p>Dieses Feld gilt nur für Aufträge, die an einem Handelsplatz ausgeführt wurden.</p>	
31	Gültigkeitsdauer	<p>Good-For-Day: Der Auftrag erlischt am Ende des Handelstags, an dem er in das Orderbuch eingegeben wurde.</p> <p>Good-Till-Cancelled: Der Auftrag ist so lange im Orderbuch aktiv und ist ausführbar, bis er storniert wird.</p> <p>Good-Till-Time: Der Auftrag erlischt 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</p>	<p>„GDAY“ – Good-For-Day</p> <p>„GTCA“ – Good-Till-Cancelled</p> <p>„GTHT“ – Good-Till-Time</p> <p>„GTHD“ – Good-Till-Date</p> <p>„GTDT“ – Good-Till-Specified Date and Time</p> <p>„GAFT“ – Good After Time</p> <p>„GAFD“ – Good After Date</p>

¹⁵ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards bezüglich der Daten, die Ausführungsplätze zur Qualität der Ausführung von Geschäften veröffentlichen müssen (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		<p>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>„GADT“ – Good After Specified Date and Time</p> <p>„IOCA“ – Immediate-Or-Cancel</p> <p>„F “ – Fill-Or-Kill oder {ALPHANUM-4} Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden</p>
32	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, Teilnehmer oder Kunden des Handelsplatzes, das/der den Auftrag eingereicht hat, vorab festgelegt werden, wie Eröffnungs- und/oder Schlussauktionen und/oder Auktionen innerhalb eines Tages).</p> <p>Valid For Continuous Trading only: Der Auftrag ist nur während des fortlaufenden Handels aktiv.</p>	<p>„SESR“ – Good For Closing Price Crossing Session</p> <p>„VFAR“ – Valid For Auction</p> <p>„VFAR“ – Valid For Continuous Trading only</p> <p>{ALPHANUM-4}</p>

		Sonstige: alle weiteren Angaben, die speziell für bestimmte Geschäftsmodelle, Handelsplattformen oder Handelssysteme gelten.	Zeichen, die in der eigenen Klassifikation des Handelsplatzes noch nicht verwendet werden Treffen mehrere Möglichkeiten zu, sind diese hier durch Kommata getrennt anzugeben.
33	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>{DATE_TIME_FORMAT }</p> <p>Die Anzahl der Stellen nach den „Sekunden“ ist gemäß Tabelle 2 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) .../... der Kommission¹⁶ zu bestimmen.</p>

¹⁶ Delegierte Verordnung (EU) .../... der Kommission vom ... zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Grad an Genauigkeit von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren (ABl. [...] vom [...], S. [...]).

		<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 der der Auftrag infolge des Handelsbetriebs automatisch gelöscht wird.</p> <p>Sonstige: Zeitstempel für jeden weiteren Gültigkeitstyp.</p>	
34	Sammelauftrag	Angabe, ob es sich bei dem Auftrag um einen Sammelauftrag gemäß Artikel 2 Absatz 3 der [technischen Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente] handelt.	<p>„zutreffend“</p> <p>„nicht zutreffend“</p>
35	Zusätzliche Angaben zum ausgehenden Auftrag	<p>Etwaige Anweisungen, Parameter, Bedingungen und andere Einzelheiten des Auftrags, die:</p> <p>von der Wertpapierfirma an den Handelsplatz übermittelt werden, insbesondere diejenigen Anweisungen, Parameter, Bedingungen und Einzelheiten, die der Handelsplatz kennen muss, um genau zu wissen, wie der Auftrag bearbeitet werden soll, oder</p> <p>vom Handelsplatz an die Wertpapierfirma übermittelt werden, insbesondere diejenigen Anweisungen, Parameter, Bedingungen und Einzelheiten, die die Wertpapierfirma kennen muss, um genau zu wissen, wie der Auftrag bearbeitet wurde.</p>	Freitext