

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2017/580 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ**της 24ης Ιουνίου 2016****για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την τήρηση σχετικών στοιχείων που αφορούν εντολές για χρηματοπιστωτικά μέσα****(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)**

Η ΕΥΡΩΠΑΪΚΗ ΕΠΙΤΡΟΠΗ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 15ης Μαΐου 2014, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012⁽¹⁾, και ιδίως το άρθρο 25 παράγραφος 3 τέταρτο εδάφιο,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Ο διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να μπορούν να αποφασίζουν ελεύθερα τον τρόπο με τον οποίο τηρούν αρχεία δεδομένων που αφορούν όλες τις εντολές σχετικά με χρηματοπιστωτικά μέσα. Ωστόσο, για να είναι δυνατή η αποτελεσματική και αποδοτική συγκέντρωση, σύγκριση και ανάλυση των σχετικών δεδομένων εντολών για σκοπούς παρακολούθησης της αγοράς, οι εν λόγω πληροφορίες θα πρέπει να τίθενται στη διάθεση των αρμόδιων αρχών με τη χρήση ενιαίων προτύπων και μορφοτύπων, στην περίπτωση που μια αρμόδια αρχή ζητεί τις εν λόγω πληροφορίες σύμφωνα με το άρθρο 25 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.
- (2) Για να διασφαλίζεται η σαφήνεια και η ασφάλεια δικαίου και για να αποφεύγεται η διπλή αποθήκευση των ίδιων πληροφοριών, ο παρών κανονισμός θα πρέπει να καλύπτει όλα τα στοιχεία δεδομένων αναφορικά με εντολές, συμπεριλαμβανομένων λεπτομερειών που πρέπει να γνωστοποιούνται σύμφωνα με το άρθρο 26 παράγραφοι 1 και 3.
- (3) Προκειμένου να εντοπίζονται και να διερευνώνται αποτελεσματικά περιστατικά δυνητικής κατάχρησης της αγοράς ή απόπειρας κατάχρησης της αγοράς, οι αρμόδιες αρχές πρέπει να ταυτοποιούν άμεσα πρόσωπα και οντότητες που ενδέχεται να συμμετέχουν ενεργά στη διαδικασία εντολής, συμπεριλαμβανομένων μελών ή συμμετεχόντων στον τόπο διαπραγμάτευσης, οντοτήτων που είναι υπεύθυνες για τις επενδυτικές αποφάσεις και τις αποφάσεις εκτέλεσης, μη εκτελούντων μεσιτών και πελατών εκ μέρους των οποίων εισάγονται εντολές. Αντιστοίχως, οι διαχειριστές των τόπων διαπραγμάτευσης πρέπει να διατηρούν χαρακτηριστικά στοιχεία για τα εν λόγω πρόσωπα.
- (4) Για να είναι σε θέση οι αρμόδιες αρχές να εντοπίζουν αποτελεσματικότερα ύποπτα μοντέλα δυνητικώς καταχρηστικής συμπεριφοράς από έναν πελάτη, συμπεριλαμβανομένων των περιπτώσεων στις οποίες ένας πελάτης ενεργεί μέσω διαφόρων επιχειρήσεων επενδύσεων, οι διαχειριστές των τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να καταγράφουν την ταυτότητα των πελατών εκ μέρους των οποίων τα μέλη ή οι συμμετέχοντες σε αυτούς υπέβαλαν την εντολή. Οι διαχειριστές θα πρέπει να ταυτοποιούν αυτούς τους πελάτες με μοναδικά αναγνωριστικά στοιχεία, προκειμένου να διευκολύνουν τη βέβαιη και αποδοτική ταυτοποίηση των εν λόγω προσώπων και, επομένως, να διευκολύνουν την αποτελεσματικότερη ανάλυση περιστατικών δυνητικής κατάχρησης της αγοράς στα οποία ενδέχεται να συμμετέχουν πελάτες.
- (5) Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης δεν θα πρέπει να υποχρεούνται να καταγράφουν αναγνωριστικά στοιχεία πελατών για όλους στους πελάτες στην αλυσίδα διαπραγμάτευσης αλλά μόνο για τον πελάτη εκ μέρους του οποίου υπέβαλε την εντολή το μέλος ή ο συμμετέχων.
- (6) Η αναγνώριση στρατηγικών ειδικής διαπραγμάτευσης ή παρόμοιων δραστηριοτήτων είναι σημαντική, ώστε να επιτρέπεται η αποδοτική ανίχνευση περιστατικών χειραγώγησης της αγοράς. Με αυτόν τον τρόπο, οι αρμόδιες αρχές μπορούν να διακρίνουν τη ροή εντολών που προέρχεται από μια επιχείρηση επενδύσεων που ενεργεί με βάση όρους προκαθορισμένους από τον εκδότη του μέσου το οποίο είναι το αντικείμενο της εντολής ή από τον τόπο διαπραγμάτευσης στον οποίο υποβάλλεται η εντολή από τη ροή εντολών που προέρχεται από μια επιχείρηση επενδύσεων η οποία ενεργεί κατά τη διακριτική της ευχέρεια ή κατά τη διακριτική ευχέρεια του πελάτη της.
- (7) Θα πρέπει να τηρείται αρχείο της ακριβούς ημερομηνίας και ώρας και των λεπτομερειών οποιαδήποτε τοποθέτησης, τροποποίησης, ακύρωσης, απόρριψης και εκτέλεσης εντολής. Με αυτόν τον τρόπο καθίσταται δυνατή η παρακολούθηση των αλλαγών τις οποίες υφίσταται η εντολή καθ' όλη τη διάρκεια του κύκλου ζωής της, γεγονός που μπορεί να είναι σημαντικό για τον εντοπισμό και την αξιολόγηση περιστατικών δυνητικής χειραγώγησης της αγοράς και συμπεριφορών προπορευόμενων συναλλαγών (front running).

⁽¹⁾ ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 84.

- (8) Για να εξασφαλιστεί η ακριβής και πλήρης εικόνα του βιβλίου εντολών ενός τόπου διαπραγμάτευσης, οι αρμόδιες αρχές ζητούν πληροφορίες για τις συνεδριάσεις διαπραγμάτευσης κατά τις οποίες τελούν υπό διαπραγμάτευση χρηματοπιστωτικά μέσα. Αυτές οι πληροφορίες μπορούν να χρησιμοποιηθούν ιδίως για να προσδιοριστεί πότε ξεκινούν και τελειώνουν οι περίοδοι δημοπρασίας ή η συνεχής διαπραγμάτευση και εάν προκαλούνται μη προγραμματισμένες διακοπές διαπραγμάτευσης λόγω εντολών. Αυτές οι πληροφορίες είναι επίσης απαραίτητες για να προσδιοριστεί πώς θα αλληλεπιδράσουν οι εντολές, ιδίως στην περίπτωση που οι συνεδριάσεις τελειώνουν σε τυχαίες χρονικές περιόδους, όπως οι δημοπρασίες. Πληροφορίες για ενδεικτικές τελικές τιμές (uncrossing prices) και όγκους δημοπρασίας θα συνέβαλαν επίσης στην ανάλυση περιστατικών δυναμικής χειραγώγησης της δημοπρασίας. Δεδομένου ότι μια μεμονωμένη εντολή μπορεί να επηρεάσει είτε την τελική τιμή δημοπρασίας είτε τον τελικό όγκο δημοπρασίας είτε αμφότερα, οι αρμόδιες αρχές πρέπει να βλέπουν τον αντίκτυπο κάθε εντολής σε αυτές τις τιμές. Εάν δεν παρέχονται αυτές οι πληροφορίες, θα είναι δύσκολο να εντοπιστεί ποια εντολή έχει αντίκτυπο σε αυτές τις τιμές. Επιπροσθέτως, θα πρέπει να αποδοθεί σε κάθε σχετικό συμβάν αύξων αριθμός, ώστε να προσδιορίζεται η ακολουθία των συμβάντων, όταν δύο ή περισσότερα συμβάντα λαμβάνουν χώρα ταυτόχρονα.
- (9) Ο προσδιορισμός της θέσης των εντολών σε ένα βιβλίο εντολών επιτρέπει να ανασυσταθεί το βιβλίο εντολών και να αναλυθεί η ακολουθία εκτέλεσης των εντολών, στοιχείο σημαντικό για την εποπτεία της κατάχρησης της αγοράς. Η θέση που έχει δοθεί σε μια εντολή εξαρτάται από το πώς προσδιορίζεται η προτεραιότητα από το σύστημα διαπραγμάτευσης. Επομένως, οι διαχειριστές των τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να χρησιμοποιούν και να τηρούν λεπτομερή στοιχεία της προτεραιότητας των εντολών σύμφωνα με τη μέθοδο προτεραιότητας τιμής-παρουσίας-χρόνου ή μεγέθους-χρόνου.
- (10) Για να είναι δυνατή η αποτελεσματική παρακολούθηση της αγοράς, οι εντολές θα πρέπει να μπορούν να συνδέονται με τις αντίστοιχες συναλλαγές τους. Αντιστοίχως, οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να τηρούν χαρακτηριστικούς αναγνωριστικούς κωδικούς συναλλαγών οι οποίοι θα συνδέουν εντολές με συναλλαγές.
- (11) Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει, για κάθε εντολή που λαμβάνουν, να καταγράφουν και να τηρούν σε αρχείο το είδος εντολής και τις σχετικές συγκεκριμένες οδηγίες που από κοινού προσδιορίζουν τον τρόπο χειρισμού της εντολής από τους μηχανισμούς αντιστοίχισής τους σύμφωνα με τη δική τους ταξινόμηση. Αυτές οι λεπτομερείς πληροφορίες είναι απαραίτητες ώστε οι αρμόδιες αρχές να μπορούν να παρακολουθούν, στο πλαίσιο της εποπτείας της κατάχρησης της αγοράς, τη δραστηριότητα διαπραγμάτευσης σε ένα δεδομένο βιβλίο εντολών του τόπου διαπραγμάτευσης και, ιδίως, να αναπαράγουν πώς συμπεριφέρεται κάθε εντολή μέσα στο βιβλίο εντολών. Ωστόσο, δεδομένου του μεγάλου εύρους υφιστάμενων και δυναμικών νέων ειδών εντολών που σχεδιάζονται από διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης και των συγκεκριμένων τεχνικών ζητημάτων που συνδέονται με αυτούς, η τήρηση αυτών των λεπτομερών πληροφοριών σύμφωνα με το εσωτερικό σύστημα ταξινόμησης των διαχειριστών μπορεί να μην επιτρέπει σήμερα στις αρμόδιες αρχές να αναπαράγουν τη δραστηριότητα του βιβλίου εντολών όλων των τόπων διαπραγμάτευσης κατά τρόπο συνεκτικό. Επομένως, για να είναι σε θέση οι αρμόδιες αρχές να εντοπίζουν με ακρίβεια κάθε εντολή στο βιβλίο εντολών, οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης θα πρέπει να ταξινομούν επίσης κάθε εντολή που λαμβάνουν είτε ως εντολή με όριο (limit order), στην περίπτωση που η εντολή είναι διαπραγματεύσιμη, είτε ως εντολή διακοπής (stop order), στην περίπτωση που η εντολή καθίσταται διαπραγματεύσιμη μόνο με την πραγματοποίηση προκαθορισμένου συμβάντος που αφορά την τιμή.
- (12) Για λόγους συνέπειας και προκειμένου να διασφαλιστεί η ομαλή λειτουργία των χρηματοπιστωτικών αγορών, είναι αναγκαίο οι διατάξεις που προβλέπονται στον παρόντα κανονισμό και εκείνες που προβλέπονται στον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 600/2014 να εφαρμόζονται από την ίδια ημερομηνία.
- (13) Ο παρών κανονισμός βασίζεται στα σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων που υπέβαλε η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ΕΑΚΑΑ) στην Επιτροπή.
- (14) Η ΕΑΚΑΑ διενήργησε ανοικτές δημόσιες διαβουλεύσεις σχετικά με τα σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων στα οποία βασίζεται ο παρών κανονισμός, προέβη σε ανάλυση του δυναμικού σχετικού κόστους/οφέλους και ζήτησε τη γνώμη της ομάδας συμφεροντούχων κινητών αξιών και αγορών που συστάθηκε σύμφωνα με το άρθρο 37 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽¹⁾,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Πεδίο εφαρμογής, πρότυπα και μορφότυπος των σχετικών δεδομένων εντολών

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης θέτουν στη διάθεση των αρμόδιων αρχών τους τα λεπτομερή στοιχεία κάθε εντολής που διαφημίζεται μέσω των συστημάτων τους τα οποία ορίζονται στα άρθρα 2 έως 13, όπως προσδιορίζεται στη δεύτερη και στην τρίτη στήλη του πίνακα 2 του παραρτήματος, εφόσον αυτά αφορούν την οικεία εντολή.

⁽¹⁾ Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών), την τροποποίηση της απόφασης αριθ. 716/2009/ΕΚ και την κατάργηση της απόφασης 2009/77/ΕΚ της Επιτροπής (ΕΕ L 331 της 15.12.2010, σ. 84).

2. Στην περίπτωση που οι αρμόδιες αρχές ζητούν οποιοδήποτε από τα λεπτομερή στοιχεία που αναφέρονται στην παράγραφο 1 σύμφωνα με το άρθρο 25 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι διαχειριστές των τόπων διαπραγμάτευσης παρέχουν τα εν λόγω λεπτομερή στοιχεία με τη χρήση των προτύπων και των μορφοτύπων που ορίζονται στην τέταρτη στήλη του πίνακα 2 του παραρτήματος του παρόντος κανονισμού.

Άρθρο 2

Ταυτοποίηση των οικείων μερών

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν, για όλες τις εντολές, αρχεία τα οποία αφορούν τα εξής:
 - α) το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης που υπέβαλε την εντολή στον τόπο διαπραγμάτευσης, ο οποίος ταυτοποιείται όπως προσδιορίζεται στο πεδίο 1 του πίνακα 2 του παραρτήματος·
 - β) το πρόσωπο ή τον υπολογιστικό αλγόριθμο εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης στον οποίο υπεβλήθη η εντολή, που είναι υπεύθυνος για την επενδυτική απόφαση σχετικά με την εντολή, ο οποίος προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 4 του πίνακα 2 του παραρτήματος·
 - γ) το πρόσωπο ή τον υπολογιστικό αλγόριθμο εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης που είναι υπεύθυνος για την εκτέλεση της εντολής, ο οποίος προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 5 του πίνακα 2 του παραρτήματος·
 - δ) το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης που δρομολόγησε την εντολή εκ μέρους και στο όνομα άλλου μέλους ή συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης, ο οποίος προσδιορίζεται ως μη εκτελών μεσίτης όπως ορίζεται στο πεδίο 6 του πίνακα 2 του παραρτήματος·
 - ε) τον πελάτη εκ μέρους του οποίου το μέλος ή ο συμμετέχων στον τόπο διαπραγμάτευσης υπέβαλε την εντολή στον τόπο διαπραγμάτευσης, ο οποίος προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 3 του πίνακα 2 του παραρτήματος.
2. Στην περίπτωση που μέλος ή συμμετέχων ή πελάτης του τόπου διαπραγμάτευσης έχει λάβει άδεια δυνάμει της νομοθεσίας κράτους μέλους να καταλείπει εντολή στον πελάτη του μετά την υποβολή της εντολής στον τόπο διαπραγμάτευσης και δεν έχει καταλείψει ακόμα την εντολή στον πελάτη του κατά τον χρόνο υποβολής της εντολής, η εντολή αυτή προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 3 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

3. Στην περίπτωση που υποβάλλονται περισσότερες από μία εντολές στον τόπο διαπραγμάτευσης από κοινού ως ομαδοποιημένη εντολή, η ομαδοποιημένη εντολή προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 3 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

Άρθρο 3

Ιδιότητα διαπραγματευτή των μελών ή των συμμετεχόντων στον τόπο διαπραγμάτευσης και δραστηριότητα παροχής ρευστότητας

1. Η ιδιότητα διαπραγματευτή με την οποία το μέλος ή ο συμμετέχων στον τόπο διαπραγμάτευσης υποβάλλει μια εντολή προσδιορίζεται όπως ορίζεται στο πεδίο 7 του πίνακα 2 του παραρτήματος.
2. Οι ακόλουθες εντολές προσδιορίζονται όπως ορίζεται στο πεδίο 8 του πίνακα 2 του παραρτήματος:
 - α) εντολή η οποία υποβάλλεται σε τόπο διαπραγμάτευσης από μέλος ή συμμετέχοντα στο πλαίσιο στρατηγικής ειδικής διαπραγμάτευσης σύμφωνα με άρθρα 17 και 48 της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽¹⁾·
 - β) εντολή η οποία υποβάλλεται σε τόπο διαπραγμάτευσης από μέλος ή συμμετέχοντα στο πλαίσιο οποιασδήποτε άλλης δραστηριότητας παροχής ρευστότητας η οποία διεξάγεται βάσει όρων προκαθορισμένων είτε από τον εκδότη του μέσου που είναι αντικείμενο της εντολής είτε από τον συγκεκριμένο τόπο διαπραγμάτευσης.

⁽¹⁾ Οδηγία 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 15ης Μαΐου 2014, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και την τροποποίηση της οδηγίας 2002/92/ΕΚ και της οδηγίας 2011/61/ΕΕ (ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 349).

Άρθρο 4

Καταγραφή ημερομηνίας και ώρας

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο της ημερομηνίας και της ώρας που συνέβη κάθε συμβάν το οποίο απαριθμείται στο πεδίο 21 του πίνακα 2 του παραρτήματος του παρόντος κανονισμού, με την ακρίβεια που προσδιορίζεται στο άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574 της Επιτροπής⁽¹⁾ όπως ορίζεται στο πεδίο 9 του πίνακα 2 του παραρτήματος του παρόντος κανονισμού. Με την εξαίρεση της καταγραφής της ημερομηνίας και της ώρας της απόρριψης εντολών από τα συστήματα του τόπου διαπραγμάτευσης, όλα τα συμβάντα που αναφέρονται στο πεδίο 21 του πίνακα 2 του παραρτήματος του παρόντος κανονισμού καταγράφονται με τη χρήση των ρολογιών εργασίας που χρησιμοποιούνται από τους μηχανισμούς αντιστοίχισης του τόπου διαπραγμάτευσης.
2. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο της ημερομηνίας και της ώρας κάθε στοιχείου δεδομένων που απαριθμείται στα πεδία 49, 50 και 51 του πίνακα 2 του παραρτήματος του παρόντος κανονισμού με την ακρίβεια που προσδιορίζεται στο άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574.

Άρθρο 5

Περίοδος ισχύος και περιορισμοί εντολής

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο των περιόδων ισχύος και των περιορισμών της εντολής που απαριθμούνται στα πεδία 10 και 11 του πίνακα 2 του παραρτήματος.
2. Τηρούνται αρχεία ημερομηνίας και ώρας αναφορικά με τις περιόδους ισχύος όπως ορίζεται στο πεδίο 12 του πίνακα 2 του παραρτήματος για κάθε περίοδο ισχύος.

Άρθρο 6

Προτεραιότητα και αύξων αριθμός

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης που λειτουργούν συστήματα διαπραγμάτευσης με προτεραιότητα τιμής-παρουσίας-χρόνου τηρούν αρχείο με τις χρονοσημάνσεις προτεραιότητας για όλες τις εντολές, όπως ορίζεται στο πεδίο 13 του πίνακα 2 του παραρτήματος. Η χρονοσήμανση προτεραιότητας τηρείται με την ακρίβεια που προσδιορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1.
2. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης που λειτουργούν συστήματα διαπραγμάτευσης με βάση προτεραιότητα μεγέθους-χρόνου τηρούν αρχείο των ποσοτήτων που καθορίζουν την προτεραιότητα των εντολών, όπως ορίζεται στο πεδίο 14 του πίνακα 2 του παραρτήματος, καθώς και της χρονοσημάνσης προτεραιότητας που αναφέρεται στην παράγραφο 1.
3. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης που χρησιμοποιούν συνδυασμό προτεραιότητας τιμής-παρουσίας-χρόνου και προτεραιότητας μεγέθους-χρόνου και εμφανίζουν εντολές στο βιβλίο εντολών τους με χρονική προτεραιότητα συμμορφώνονται με την παράγραφο 1.
4. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης που χρησιμοποιούν συνδυασμό προτεραιότητας τιμής-παρουσίας-χρόνου και προτεραιότητας μεγέθους-χρόνου και εμφανίζουν εντολές στο βιβλίο εντολών τους με προτεραιότητα μεγέθους-χρόνου συμμορφώνονται με την παράγραφο 2.
5. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης αποδίδουν και τηρούν αύξοντα αριθμό για όλα τα συμβάντα, όπως ορίζεται στο πεδίο 15 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

Άρθρο 7

Αναγνωριστικοί κωδικοί εντολών για χρηματοπιστωτικά μέσα

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν μεμονωμένο αναγνωριστικό κωδικό για κάθε εντολή, όπως ορίζεται στο πεδίο 20 του πίνακα 2 του παραρτήματος. Ο αναγνωριστικός κωδικός είναι μοναδικός ανά βιβλίο εντολών, ανά ημέρα διαπραγμάτευσης και ανά χρηματοπιστωτικό μέσο. Εφαρμόζεται από την παραλαβή της εντολής από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης έως την απαλοιφή της εντολής από το βιβλίο εντολών. Ο αναγνωριστικός κωδικός εφαρμόζεται επίσης σε απορριφθείσες εντολές, ανεξαρτήτως του λόγου απόρριψής τους.

⁽¹⁾ Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/574 της Επιτροπής, της 7ης Ιουνίου 2016, για τη συμπλήρωση της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για το επίπεδο ακρίβειας των ρολογιών εργασίας (βλέπε σελίδα 148 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

2. Ο διαχειριστής του τόπου διαπραγμάτευσης τηρεί τα σχετικά λεπτομερή στοιχεία εντολών στρατηγικής με λειτουργία συνεπαγωγής (SOIF) τα οποία γνωστοποιούνται στο κοινό όπως προσδιορίζεται στο παράρτημα. Στο πεδίο 33 του πίνακα 2 του παραρτήματος περιλαμβάνεται δήλωση για το αν η εντολή είναι έμμεση εντολή.

Με την εκτέλεση μιας SOIF, τα λεπτομερή στοιχεία της τηρούνται από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης όπως προσδιορίζεται στο παράρτημα.

Με την εκτέλεση μιας SOIF, ο αναγνωριστικός κωδικός εντολής που συνδέεται με στρατηγική δηλώνεται με τη χρήση του ίδιου αναγνωριστικού κωδικού για όλες τις εντολές που συνδέονται με τη συγκεκριμένη στρατηγική. Ο αναγνωριστικός κωδικός εντολής που συνδέεται με στρατηγική προσδιορίζεται στο πεδίο 46 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

3. Εντολές οι οποίες υποβάλλονται σε τόπο διαπραγμάτευσης και επιτρέπουν στρατηγική δρομολόγησης προσδιορίζονται από τον εν λόγω τόπο διαπραγμάτευσης ως «δρομολογημένες», όπως ορίζεται στο πεδίο 33 του πίνακα 2 του παραρτήματος, όταν αυτές δρομολογούνται σε άλλον τόπο διαπραγμάτευσης. Εντολές οι οποίες υποβάλλονται σε τόπο διαπραγμάτευσης και επιτρέπουν στρατηγική δρομολόγησης διατηρούν τον ίδιο αναγνωριστικό κωδικό καθ' όλη τη διάρκεια της ζωής τους, ανεξαρτήτως αν οποιαδήποτε εναπομείνουσα ποσότητα εμφανίζεται εκ νέου στο βιβλίο εντολών στο οποίο καταχωρίστηκαν.

Άρθρο 8

Συμβάντα που επηρεάζουν τις εντολές για χρηματοπιστωτικά μέσα

Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο με τα λεπτομερή στοιχεία που αναφέρονται στο πεδίο 21 του πίνακα 2 του παραρτήματος όσον αφορά τις νέες εντολές.

Άρθρο 9

Είδος εντολής για χρηματοπιστωτικά μέσα

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο με τα είδη εντολής για κάθε εντολή που λαμβάνουν χρησιμοποιώντας τη δική τους ταξινόμηση, όπως προσδιορίζεται στο πεδίο 22 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

2. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης κατατάσσουν κάθε εντολή που έχουν λάβει είτε ως εντολή διακοπής είτε ως εντολή με όριο, όπως προσδιορίζεται στο πεδίο 23 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

Άρθρο 10

Τιμές σχετικά με εντολές

Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο με όλα τα λεπτομερή στοιχεία που αφορούν τις τιμές τα οποία αναφέρονται στο τμήμα Θ του πίνακα 2 του παραρτήματος, εφόσον αυτά αφορούν τις εντολές.

Άρθρο 11

Οδηγίες για εντολές

Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο όλων των οδηγιών που λαμβάνουν για κάθε εντολή, όπως προσδιορίζεται στο τμήμα I του πίνακα 2 του παραρτήματος.

Άρθρο 12

Αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής του τόπου διαπραγμάτευσης

Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αναγνωριστικό κωδικό επιμέρους συναλλαγής για κάθε συναλλαγή που είναι αποτέλεσμα της ολικής ή μερικής εκτέλεσης μιας εντολής, όπως προσδιορίζεται στο πεδίο 48 του πίνακα 2 του παραρτήματος.

Άρθρο 13

Φάσεις διαπραγμάτευσης, ενδεικτική τιμή δημοπρασίας και ενδεικτικός όγκος δημοπρασίας

1. Οι διαχειριστές τόπων διαπραγμάτευσης τηρούν αρχείο με τα λεπτομερή στοιχεία των εντολών, όπως προσδιορίζεται στο τμήμα ΙΑ του πίνακα 2 του παραρτήματος.
2. Στην περίπτωση που ζητούνται από τις αρμόδιες αρχές λεπτομερή στοιχεία αναφερόμενα στο τμήμα ΙΑ σύμφωνα με το άρθρο 1, τα στοιχεία που αναφέρονται στα πεδία 9 και 15 έως 18 του πίνακα 2 του παραρτήματος θεωρούνται επίσης στοιχεία σχετικά με την εντολή τα οποία αφορά η εν λόγω αίτηση παροχής στοιχείων.

Άρθρο 14

Έναρξη ισχύος και εφαρμογή

Ο παρών κανονισμός τίθεται σε ισχύ την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Εφαρμόζεται από την ημερομηνία που αναφέρεται στο άρθρο 55 δεύτερο εδάφιο του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

Βρυξέλλες, 24 Ιουνίου 2016.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
Jean-Claude JUNCKER

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Πίνακας 1

Υπόμνημα του πίνακα 2

ΣΥΜΒΟΛΟ	ΤΥΠΟΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ	ΟΡΙΣΜΟΣ
{ALPHANUM-n}	Έως n αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Πεδίο με ελεύθερο κείμενο.
{CURRENCYCODE_3}	3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός νομίσματος με 3 γράμματα, όπως ορίζεται στους κωδικούς νομίσματος ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Μορφότυπος ημερομηνίας και ώρας ISO 8601	<p>Ημερομηνία και ώρα με τον ακόλουθο μορφότυπο: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddZ.</p> <ul style="list-style-type: none"> — «YYYY» είναι το έτος· — «MM» είναι ο μήνας· — «DD» είναι η ημέρα· — «T» — σημαίνει ότι πρέπει να χρησιμοποιείται το γράμμα «T» — «hh» είναι η ώρα· — «mm» είναι το λεπτό· — «ss.dddZ» είναι το δευτερόλεπτο και το κλάσμα δευτερολέπτου· — Z είναι η συντονισμένη παγκόσμια ώρα UTC. <p>Οι ημερομηνίες και οι ώρες πρέπει να αναφέρονται σε UTC.</p>
{DATEFORMAT}	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	<p>Οι ημερομηνίες έχουν τον εξής μορφότυπο: YYYY-MM-DD.</p>
{DECIMAL-n/m}	Δεκαδικός αριθμός με το πολύ n ψηφία συνολικά εκ των οποίων το πολύ m ψηφία μπορεί να είναι κλασματικά ψηφία.	<p>Αριθμητικό πεδίο τόσο για θετικές όσο και για αρνητικές τιμές.</p> <ul style="list-style-type: none"> — σημείο υποδιαστολής:«.» (τελεία)· — οι αρνητικοί αριθμοί έχουν πρόσημο «-» (μείον)· — οι τιμές στρογγυλεύονται χωρίς αποκοπή.
{INTEGER-n}	Ακέραιος αριθμός με το πολύ n ψηφία συνολικά	Αριθμητικό πεδίο τόσο για θετικές όσο και για αρνητικές ακέραιες τιμές.
{ISIN}	12 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός ISIN, όπως ορίζεται στο ISO 6166
{LEI}	20 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας, όπως ορίζεται στο ISO 17442
{MIC}	4 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς, όπως ορίζεται στο ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Ο αναγνωριστικός κωδικός είναι εκείνος που ορίζεται στο άρθρο 6 και στο παράρτημα II του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590 της Επιτροπής ⁽¹⁾ .

(1) Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/590 της Επιτροπής, της 28ης Ιουλίου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την αναφορά των συναλλαγών στις αρμόδιες αρχές (βλέπε σελίδα 449 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

Πίνακας 2

Λεπτομερή στοιχεία εντολών

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
Τμήμα Α — Ταυτοποίηση των οικείων μερών			
1	Ταυτοποίηση της οντότητας που υπέβαλε την εντολή	Η ταυτότητα του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης. Σε περίπτωση άμεσης ηλεκτρονικής πρόσβασης, αναφέρεται η ταυτότητα του παρόχου άμεσης ηλεκτρονικής πρόσβασης.	{LEI}
2	Άμεση ηλεκτρονική πρόσβαση	«true» (σωστό), εάν η εντολή υποβλήθηκε στον τόπο διαπραγμάτευσης με τη χρήση άμεσης ηλεκτρονικής πρόσβασης, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 41) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ. «false» (λάθος), εάν η εντολή δεν υποβλήθηκε στον τόπο διαπραγμάτευσης με τη χρήση άμεσης ηλεκτρονικής πρόσβασης, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 41) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ.	«true» (σωστό) «false» (λάθος)
3	Αναγνωριστικός κωδικός πελάτη	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την ταυτοποίηση του πελάτη του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης. Σε περίπτωση που υπάρχει άμεση ηλεκτρονική πρόσβαση, χρησιμοποιείται ο κωδικός του χρήστη άμεσης ηλεκτρονικής πρόσβασης. Εάν ο πελάτης είναι νομική οντότητα, χρησιμοποιείται ο κωδικός LEI του πελάτη. Εάν ο πελάτης δεν είναι νομική οντότητα, χρησιμοποιείται ο {NATIONAL_ID}. Στην περίπτωση ομαδοποιημένων εντολών, χρησιμοποιείται η σήμανση AGGR, όπως διευκρινίζεται στο άρθρο 2 παράγραφος 3 του παρόντος κανονισμού. Στην περίπτωση κατανομών σε εκκρεμότητα, χρησιμοποιείται η σήμανση PNAL, όπως διευκρινίζεται στο άρθρο 2 παράγραφος 2 του παρόντος κανονισμού. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται μόνον εάν το μέλος ή ο συμμετέχων στον τόπο διαπραγμάτευσης δεν διαθέτει πελάτη.	{LEI} {NATIONAL_ID} «AGGR» — ομαδοποιημένες εντολές «PNAL» — κατανομές σε εκκρεμότητα
4	Επενδυτική απόφαση εντός της επιχείρησης	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την ταυτοποίηση του προσώπου ή του αλγόριθμου εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης ο οποίος είναι υπεύθυνος για την επενδυτική απόφαση, σύμφωνα με το άρθρο 8 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590. Στην περίπτωση που υπεύθυνος για την επενδυτική απόφαση είναι φυσικό πρόσωπο εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης, το πρόσωπο που είναι υπεύθυνο ή που έχει την κύρια ευθύνη για την επενδυτική απόφαση προσδιορίζεται με τη χρήση του {NATIONAL_ID}. Στην περίπτωση που υπεύθυνος για την επενδυτική απόφαση ήταν ένας αλγόριθμος, το πεδίο συμπληρώνεται όπως ορίζεται στο άρθρο 8 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590. Το πεδίο αυτό δεν συμπληρώνεται όταν η επενδυτική απόφαση δεν ελήφθη από πρόσωπο ή αλγόριθμο εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης.	{NATIONAL_ID} — Φυσικά πρόσωπα {ALPHANUM-50} — Αλγόριθμοι
5	Εκτέλεση εντός της επιχείρησης	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την ταυτοποίηση του προσώπου ή του αλγόριθμου εντός του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης, ο οποίος είναι υπεύθυνος για την εκτέλεση της συναλλαγής που είναι αποτέλεσμα της εντολής, σύμφωνα με το άρθρο 9 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590. Στην περίπτωση που υπεύθυνος για την εκτέλεση της συναλλαγής είναι φυσικό πρόσωπο, το πρόσωπο προσδιορίζεται με τη χρήση του {NATIONAL_ID}.	{NATIONAL_ID} — Φυσικά πρόσωπα {ALPHANUM-50} — Αλγόριθμοι

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		<p>Στην περίπτωση που υπεύθυνος για την εκτέλεση της συναλλαγής είναι ένας αλγόριθμος, το συγκεκριμένο πεδίο συμπληρώνεται σύμφωνα με το άρθρο 9 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590.</p> <p>Στην περίπτωση που περισσότερα του ενός πρόσωπα ή συνδυασμός προσώπων και αλγορίθμων συμμετέχουν στην εκτέλεση της συναλλαγής, το μέλος ή ο συμμετέχων ή ο πελάτης του τόπου διαπραγμάτευσης προσδιορίζει τον συναλλασσόμενο ή τον αλγόριθμο που είναι κυρίως υπεύθυνος, όπως διευκρινίζεται στο άρθρο 9 παράγραφος 4 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590, και συμπληρώνει το συγκεκριμένο πεδίο με την ταυτότητα αυτού του συναλλασσόμενου ή αλγορίθμου.</p>	
6	Μη εκτελών μεσίτης	<p>Σύμφωνα με το άρθρο 2 στοιχείο δ).</p> <p>Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται όταν είναι άνευ αντικειμένου.</p>	{LEI}

Τμήμα Β — Ιδιότητα διαπραγματευτή και παροχή ρευστότητας

7	Ιδιότητα διαπραγματευτή	<p>Δηλώνεται αν η υποβολή της εντολής προέρχεται από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης που πραγματοποιεί αντιστοιχισμένη συναλλαγή για ίδιο λογαριασμό, σύμφωνα με το άρθρο 4 σημείο 38) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ, ή διενέργεια συναλλαγών για ίδιο λογαριασμό, σύμφωνα με το άρθρο 4 σημείο 6) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ.</p> <p>Στην περίπτωση που η υποβολή της εντολής δεν προέρχεται από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης που πραγματοποιεί αντιστοιχισμένη συναλλαγή για ίδιο λογαριασμό ή διενέργεια συναλλαγών για ίδιο λογαριασμό, στο πεδίο δηλώνεται ότι η συναλλαγή πραγματοποιήθηκε υπό οποιαδήποτε άλλη ιδιότητα.</p>	<p>«DEAL» — Διενέργεια συναλλαγών για ίδιο λογαριασμό</p> <p>«MTCH» — Αντιστοιχισμένη συναλλαγή για ίδιο λογαριασμό</p> <p>«AOTC» — Οποιαδήποτε άλλη ιδιότητα</p>
8	Δραστηριότητα παροχής ρευστότητας	<p>Δηλώνεται αν η εντολή υποβάλλεται σε τόπο διαπραγμάτευσης στο πλαίσιο στρατηγικής ειδικής διαπραγμάτευσης, σύμφωνα με τα άρθρα 17 και 48 της οδηγίας 2014/65/ΕΕ, ή υποβάλλεται στο πλαίσιο άλλης δραστηριότητας, σύμφωνα με το άρθρο 3 του παρόντος κανονισμού.</p>	<p>«true» (σωστό)</p> <p>«false» (λάθος)</p>

Τμήμα Γ — Ημερομηνία και ώρα

9	Ημερομηνία και ώρα	<p>Η ημερομηνία και ώρα κάθε συμβάντος που αναφέρεται στα τμήματα [Z] και [IA].</p>	<p>{DATE_TIME_FORMAT}</p> <p>Ο αριθμός των ψηφίων μετά τα «δευτερόλεπτα» καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574.</p>
---	--------------------	---	---

Τμήμα Δ — Περίοδος ισχύος και περιορισμοί εντολής

10	Περίοδος ισχύος	<p>Ημερήσια (Good-For-Day): η εντολή λήγει στο τέλος της ημέρας διαπραγμάτευσης κατά την οποία καταχωρίστηκε στο βιβλίο εντολών.</p> <p>Έγκυρη μέχρι ακύρωσης (Good-Till-Cancelled): η εντολή θα παραμείνει ενεργή στο βιβλίο εντολών και θα είναι εκτελέσιμη έως ότου ακυρωθεί.</p>	<p>«DAVY» — Ημερήσια</p> <p>«GTCV» — Έγκυρη μέχρι ακύρωσης</p>
----	-----------------	--	--

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		<p>Έγκυρη μέχρι ώρα (Good-Till-Time): η εντολή λήγει το αργότερο σε μια προκαθορισμένη ώρα εντός της τρέχουσας συνεδρίασης διαπραγμάτευσης.</p> <p>Έγκυρη μέχρι ημερομηνία (Good-Till-Date): η εντολή λήγει στο τέλος μιας καθορισμένης ημερομηνίας.</p> <p>Έγκυρη μέχρι καθορισμένη ημερομηνία και ώρα (Good-Till-Specified Date and Time): η εντολή λήγει σε μια καθορισμένη ημερομηνία και ώρα.</p> <p>Έγκυρη μετά από ώρα (Good After Time): η εντολή είναι ενεργή μόνον μετά από μια προκαθορισμένη ώρα εντός της τρέχουσας συνεδρίασης διαπραγμάτευσης.</p> <p>Έγκυρη μετά από ημερομηνία (Good After Date): η εντολή είναι ενεργή μόνον από την έναρξη μιας προκαθορισμένης ημερομηνίας.</p> <p>Έγκυρη μετά από καθορισμένη ημερομηνία και ώρα (Good After Specified Date and Time): η εντολή είναι ενεργή μόνον από μια προκαθορισμένη ώρα σε μια προκαθορισμένη ημερομηνία.</p> <p>Άμεση εκτέλεση ή ακύρωση (Immediate-Or-Cancel): εντολή η οποία εκτελείται μόλις καταχωριστεί στο βιβλίο εντολών (για την ποσότητα που μπορεί να εκτελεστεί) και δεν παραμένει στο βιβλίο εντολών για την υπόλοιπη ποσότητα (εάν υπάρχει) η οποία δεν έχει εκτελεστεί.</p> <p>Εκτέλεση ή ακύρωση (Fill-Or-Kill): εντολή η οποία εκτελείται μόλις καταχωριστεί στο βιβλίο εντολών, εφόσον μπορεί να εκτελεστεί ολικά: σε περίπτωση που η εντολή μπορεί να εκτελεστεί μόνον εν μέρει, απορρίπτεται αυτομάτως και, επομένως, δεν μπορεί να εκτελεστεί.</p> <p>Άλλη: οποιοσδήποτε επιπρόσθετες ενδείξεις, μοναδικές για συγκεκριμένα επιχειρηματικά μοντέλα, χώρους συναλλαγών ή συστήματα διαπραγμάτευσης.</p>	<p>«GTTV» — Έγκυρη μέχρι ώρα</p> <p>«GTDV» — Έγκυρη μέχρι ημερομηνία</p> <p>«GTSV» — Έγκυρη μέχρι καθορισμένη ημερομηνία και ώρα</p> <p>«GATV» — Έγκυρη μετά από ώρα</p> <p>«GADV» — Έγκυρη μετά από ημερομηνία</p> <p>«GASV» — Έγκυρη μετά από καθορισμένη ημερομηνία και ώρα</p> <p>«IOCV» — Άμεση εκτέλεση ή ακύρωση</p> <p>«FOKV» — Εκτέλεση ή ακύρωση ή {ALPHANUM-4} χαρακτήρες που δεν χρησιμοποιούνται ήδη από τον τόπο διαπραγμάτευσης για δικούς του σκοπούς κατάταξης.</p>
11	Περιορισμός εντολής	<p>Έγκυρη για τη συνεδρίαση διασταύρωσης τιμής κλεισίματος (Good For Closing Price Crossing Session): όταν μια εντολή υπάγεται στη συνεδρίαση διασταύρωσης τιμής κλεισίματος.</p> <p>Έγκυρη για δημοπρασία (Valid For Auction): η εντολή είναι ενεργή μόνον και μπορεί να εκτελεστεί μόνον σε φάσεις δημοπρασίας (οι οποίες μπορούν να προκαθορίζονται από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης που υπέβαλε την εντολή, π.χ. δημοπρασία ανοίγματος και κλεισίματος και/ή ενδοημερήσια δημοπρασία).</p> <p>Έγκυρη για συνεχή διαπραγμάτευση μόνον (Valid For Continuous Trading only): η εντολή είναι ενεργή μόνον κατά τη διάρκεια της συνεχούς διαπραγμάτευσης.</p>	<p>«SESR» — Έγκυρη για τη συνεδρίαση διασταύρωσης τιμής κλεισίματος</p> <p>«VFAR» — Έγκυρη για δημοπρασία</p> <p>«VFCR» — Έγκυρη για συνεχή διαπραγμάτευση μόνον</p>

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		Άλλη: οποιοσδήποτε επιπρόσθετες ενδείξεις, μοναδικές για συγκεκριμένα επιχειρηματικά μοντέλα, χώρους συναλλαγών ή συστήματα διαπραγμάτευσης.	{ALPHANUM-4} χαρακτήρες που δεν χρησιμοποιούνται ήδη από τον τόπο διαπραγμάτευσης για δικούς του σκοπούς κατάταξης. Το παρόν πεδίο συμπληρώνεται με πολλαπλές σημάνσεις, οι οποίες χωρίζονται με κόμμα, όταν εφαρμόζονται πολλαπλά είδη εντολής.
12	Περίοδος και ώρα ισχύος	Αναφέρεται στη χρονοσφραγίδα που αποτυπώνει την ώρα κατά την οποία η εντολή ενεργοποιείται ή διαγράφεται τελικά από το βιβλίο εντολών. Ημερησία: η ημερομηνία καταχώρισης με τη χρονοσφραγίδα αμέσως πριν από τα μεσάνυχτα Έγκυρη μέχρι ώρα: η ημερομηνία καταχώρισης και η ώρα που προσδιορίζεται στην εντολή. Έγκυρη μέχρι ημερομηνία: η καθορισμένη ημερομηνία λήξης με τη χρονοσφραγίδα αμέσως πριν από τα μεσάνυχτα. Έγκυρη μέχρι καθορισμένη ημερομηνία και ώρα: η καθορισμένη ημερομηνία και ώρα λήξης Έγκυρη μετά από ώρα: η ημερομηνία καταχώρισης και η καθορισμένη ώρα κατά την οποία ενεργοποιείται η εντολή Έγκυρη μετά από ημερομηνία: η καθορισμένη ημερομηνία με τη χρονοσφραγίδα αμέσως μετά τα μεσάνυχτα Έγκυρη μετά από καθορισμένη ημερομηνία και ώρα: η καθορισμένη ημερομηνία και ώρα κατά την οποία ενεργοποιείται η εντολή Έγκυρη μέχρι ακύρωσης: η τελική ημερομηνία και ώρα κατά την οποία η εντολή αποσύρεται αυτομάτως από πράξεις της αγοράς Άλλη: χρονοσφραγίδα για οποιοδήποτε άλλο πρόσθετο είδος περιόδου ισχύος.	{DATE_TIME_FORMAT} Ο αριθμός των ψηφίων μετά τα «δευτερόλεπτα» καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574.

Τμήμα Ε — Προτεραιότητα και αύξων αριθμός

13	Χρονοσφραγίδα προτεραιότητας	Το παρόν πεδίο επικαιροποιείται κάθε φορά που αλλάζει η προτεραιότητα μιας εντολής.	{DATE_TIME_FORMAT} Ο αριθμός των ψηφίων μετά τα «δευτερόλεπτα» καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574.
14	Μέγεθος προτεραιότητας	Για τόπους διαπραγμάτευσης που χρησιμοποιούν προτεραιότητα μεγέθους-χρόνου, το παρόν πεδίο συμπληρώνεται με θετικό αριθμό που αντιστοιχεί στην ποσότητα. Το παρόν πεδίο επικαιροποιείται κάθε φορά που αλλάζει η προτεραιότητα της εντολής.	Έως 20 θετικά αριθμητικά ψηφία.
15	Αύξων αριθμός	Κάθε ένα συμβάν που αναφέρεται στο τμήμα Ζ ταυτοποιείται με χρήση θετικών ακέραιων αριθμών σε αύξουσα σειρά. Ο αύξων αριθμός είναι μοναδικός για κάθε είδος συμβάντος· είναι ομοιόμορφος για όλα τα συμβάντα στα οποία έχει τεθεί χρονοσφραγίδα από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης· δεν αλλάζει για την ημερομηνία κατά την οποία έλαβε χώρα το συμβάν.	{INTEGER-50}

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
-----	-------	--	---

Τμήμα ΣΤ — Ταυτοποίηση της εντολής

16	Κωδικός MIC τμήματος	Αναγνωριστικό στοιχείο του τόπου διαπραγμάτευσης όπου υπεβλήθη η εντολή. Εάν ο τόπος διαπραγμάτευσης χρησιμοποιεί κωδικούς MIC τμήματος, χρησιμοποιείται ο κωδικός MIC τμήματος. Εάν ο τόπος διαπραγμάτευσης δεν χρησιμοποιεί κωδικούς MIC τμήματος, χρησιμοποιείται ο κωδικός MIC λειτουργίας.	{MIC}
17	Κωδικός βιβλίου εντολών	Ο αλφαριθμητικός κωδικός που έχει οριστεί από τον τόπο διαπραγμάτευσης για κάθε ένα βιβλίο εντολών.	{ALPHANUM-20}
18	Αναγνωριστικός κωδικός χρηματοπιστωτικών μέσων	Μοναδικός και μονοσήμαντος αναγνωριστικός κωδικός του χρηματοπιστωτικού μέσου	{ISIN}
19	Ημερομηνία παραλαβής	Ημερομηνία παραλαβής της αρχικής εντολής.	{DATEFORMAT}
20	Αναγνωριστικός κωδικός εντολής	Αλφαριθμητικός κωδικός που έχει αποδοθεί από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης σε μεμονωμένη εντολή.	{ALPHANUM-50}

Τμήμα Ζ — Συμβάντα που επηρεάζουν την εντολή

21	Νέα εντολή, τροποποίηση εντολής, ακύρωση εντολής, απόρριψη εντολής, μερική ή ολική εκτέλεση	<p>Νέα εντολή: παραλαβή νέας εντολής από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης.</p> <p>Ενεργοποιημένη: μια εντολή η οποία καθίσταται εκτελέσιμη ή, κατά περίπτωση, μη εκτελέσιμη εφόσον εκπληρωθεί μια προκαθορισμένη συνθήκη.</p> <p>Αντικατασταθείσα από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης: όταν μέλος, συμμετέχων ή πελάτης του τόπου διαπραγμάτευσης αποφασίσει με δική του πρωτοβουλία να αλλάξει οποιοδήποτε χαρακτηριστικό της εντολής την οποία έχει προηγουμένως καταχωρίσει στο βιβλίο εντολών.</p> <p>Αντικατασταθείσα από πράξεις της αγοράς (αυτομάτως): όταν οποιοδήποτε χαρακτηριστικό εντολής μεταβάλλεται από τα συστήματα ΤΠ του διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης. Συμπεριλαμβάνεται η περίπτωση κατά την οποία μεταβάλλονται τα τρέχοντα χαρακτηριστικά μιας προσδεδεμένης εντολής (peg order) ή μιας κυλιόμενης εντολής ΣΤΟΠ (trailing stop order) ώστε να αποτυπώνουν το πού βρίσκεται η εντολή στο βιβλίο εντολών.</p> <p>Αντικατασταθείσα από πράξεις της αγοράς (ανθρώπινη παρέμβαση): όταν οποιοδήποτε χαρακτηριστικό εντολής μεταβάλλεται από το προσωπικό του διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης. Συμπεριλαμβάνεται η περίπτωση όπου μέλος, συμμετέχων στον τόπο διαπραγμάτευσης αντιμετωπίζει προβλήματα ΤΠ και χρειάζεται να ακυρώσει τις εντολές του επείγοντως.</p> <p>Μεταβολή κατάστασης με πρωτοβουλία του μέλους/συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης. Συμπεριλαμβάνεται η ενεργοποίηση και η απενεργοποίηση.</p>	<p>«NEWO» — Νέα εντολή</p> <p>«TRIG» — Ενεργοποιημένη</p> <p>«REME» — Αντικατασταθείσα από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στον τόπο διαπραγμάτευσης</p> <p>«REMA» — Αντικατασταθείσα από πράξεις της αγοράς (αυτομάτως)</p> <p>«REMH» — Αντικατασταθείσα από πράξεις της αγοράς (ανθρώπινη παρέμβαση)</p> <p>«CHME» — Μεταβολή κατάστασης με πρωτοβουλία του μέλους/συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης</p>
----	---	---	--

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		<p>Μεταβολή κατάστασης λόγω πράξεων της αγοράς.</p> <p>Ακυρωθείσα με πρωτοβουλία του μέλους, του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης: όταν μέλος, συμμετέχων ή πελάτης αποφασίζει με δική του πρωτοβουλία να ακυρώσει την εντολή την οποία έχει προηγουμένως καταχωρίσει.</p> <p>Ακυρωθείσα από πράξεις της αγοράς. Σε αυτήν την περίπτωση περιλαμβάνεται μηχανισμός προστασίας ο οποίος προβλέπεται για επιχειρήσεις επενδύσεων που ασκούν δραστηριότητες ειδικής διαπραγμάτευσης, όπως προβλέπεται στα άρθρα 17 και 48 της οδηγίας 2014/65/ΕΕ.</p> <p>Απορριφθείσα εντολή: εντολή η οποία ελήφθη, αλλά απορρίφθηκε από τον διαχειριστή του τόπου διαπραγμάτευσης.</p> <p>Λήξασα εντολή: όταν η εντολή διαγράφεται από το βιβλίο εντολών μετά το τέλος της περιόδου ισχύος της.</p> <p>Μερικώς εκτελεσθείσα: όταν η εντολή δεν εκτελείται ολικά και, επομένως, παραμένει μια ποσότητα προς εκτέλεση.</p> <p>Εκτελεσθείσα: όταν δεν υπάρχει πλέον ποσότητα προς εκτέλεση.</p>	<p>«CHMO» — Μεταβολή κατάστασης λόγω πράξεων της αγοράς</p> <p>«CAME» — Ακυρωθείσα με πρωτοβουλία του μέλους ή του συμμετέχοντος στον τόπο διαπραγμάτευσης</p> <p>«CAMO» — Ακυρωθείσα από πράξεις της αγοράς</p> <p>«REMO» — Απορριφθείσα εντολή</p> <p>«EXPI» — Λήξασα εντολή</p> <p>«PARF» — Μερικώς εκτελεσθείσα</p> <p>«FILL» — Εκτελεσθείσα {ALPHANUM-4} χαρακτήρες που δεν χρησιμοποιούνται ήδη από τον τόπο διαπραγμάτευσης για δικούς του σκοπούς κατάταξης.</p>

Τμήμα Η — Είδος εντολής

22	Είδος εντολής	Αναγνώριση του είδους εντολής που υποβάλλεται στον τόπο διαπραγμάτευσης ανάλογα με τις προδιαγραφές του τόπου διαπραγμάτευσης.	{ALPHANUM-50}
23	Κατάταξη είδους εντολής	Κατάταξη της εντολής βάσει δύο γενικών ειδών εντολής. Εντολή με όριο (LIMIT): στις περιπτώσεις που η εντολή είναι διαπραγματεύσιμη και Εντολή διακοπής (STOP): στις περιπτώσεις που η εντολή καθίσταται διαπραγματεύσιμη μόνον με την εκπλήρωση προκαθορισμένου συμβάντος ως προς την τιμή.	Το αρκτικόλεξο «LMTO» για την εντολή με όριο ή το αρκτικόλεξο «STOP» για την εντολή διακοπής.

Τμήμα Θ — Τιμές

24	Οριακή τιμή	Η μέγιστη τιμή στην οποία μπορεί να τελεί υπό διαπραγμάτευση μια εντολή αγοράς ή η ελάχιστη τιμή στην οποία μπορεί να τελεί υπό διαπραγμάτευση μια εντολή πώλησης. Η τιμή ανοίγματος για μια εντολή στρατηγικής. Μπορεί να είναι αρνητική ή θετική.	{DECIMAL-18/13} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία. Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος.
----	-------------	--	---

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		<p>Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται στην περίπτωση εντολών που δεν διαθέτουν οριακή τιμή ή στην περίπτωση εντολών χωρίς τιμή.</p> <p>Στην περίπτωση μετατρέψιμης ομολογίας, η πραγματική τιμή (καθαρή ή μεικτή) που χρησιμοποιείται για την εντολή αποτυπώνεται σε αυτό το πεδίο.</p>	<p>{DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.</p> <p>{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης.</p>
25	Συμπληρωματική οριακή τιμή	<p>Οποιαδήποτε άλλη οριακή τιμή που ενδέχεται να ισχύει για την εντολή. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} όταν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία.</p> <p>Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος.</p> <p>{DECIMAL-11/10} όταν η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.</p> <p>{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης.</p>
26	Τιμή ΣΤΟΠ (stop price)	<p>Η τιμή που πρέπει να επιτευχθεί για να ενεργοποιηθεί η εντολή.</p> <p>Για εντολές ΣΤΟΠ (stop orders) που ενεργοποιούνται από συμβάντα ανεξάρτητα της τιμής του χρηματοπιστωτικού μέσου, το παρόν πεδίο συμπληρώνεται με μηδενική τιμή ΣΤΟΠ.</p> <p>Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} όταν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία.</p> <p>Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος.</p> <p>{DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.</p> <p>{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης.</p>
27	Προσδεδεμένη οριακή τιμή (pegged limit price)	<p>Η μέγιστη τιμή στην οποία μια προσδεδεμένη εντολή (pegged order) αγοράς μπορεί να τελει υπό διαπραγμάτευση ή η ελάχιστη τιμή στην οποία μια προσδεδεμένη εντολή πώλησης μπορεί να τελει υπό διαπραγμάτευση.</p> <p>Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.</p>	<p>{DECIMAL-18/13} όταν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία.</p> <p>Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος.</p> <p>{DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.</p> <p>{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης.</p>

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
28	Τιμή συναλλαγής	<p>Η τιμή διαπραγμάτευσης της συναλλαγής, εξαιρουμένων προμηθειών και δεδουλευμένων τόκων, κατά περίπτωση.</p> <p>Στην περίπτωση συμβολαίων δικαιωμάτων προαίρεσης, είναι η τιμή δικαιώματος (πριμ) της σύμβασης παραγώγων ανά υποκείμενο ή μονάδα του δείκτη.</p> <p>Στην περίπτωση τοποθετήσεων επί χρηματοπιστωτικών διαφορών (spread bets), είναι η τιμή αναφοράς του άμεσου υποκείμενου μέσου.</p> <p>Στην περίπτωση συμβολαίων ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS), είναι το τοκομερίδιο σε μονάδες βάσης.</p> <p>Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος.</p> <p>Όταν δεν εφαρμόζεται τιμή, το πεδίο συμπληρώνεται με την ένδειξη «NOAP».</p>	<p>{DECIMAL-18/13} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία.</p> <p>{DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.</p> <p>{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης.</p> <p>«NOAP»</p>
29	Νόμισμα τιμής	Το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται η τιμή διαπραγμάτευσης για το χρηματοπιστωτικό μέσο το οποίο αφορά η εντολή (εφαρμόζεται όταν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία).	{CURRENCYCODE_3}
30	Νόμισμα σκέλους 2	<p>Όταν υπάρχουν συμφωνίες ανταλλαγής συναλλάγματος σε διαφορετικά νομίσματα ή διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής, το νόμισμα του σκέλους 2 είναι το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το σκέλος 2 της σύμβασης.</p> <p>Για δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνίες ανταλλαγής όπου η υποκείμενη συμφωνία ανταλλαγής είναι σε διαφορετικά νομίσματα, το νόμισμα του σκέλους 2 είναι το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το σκέλος 2 της σύμβασης.</p> <p>Το παρόν πεδίο χρειάζεται να συμπληρώνεται μόνον όταν υπάρχουν συμβάσεις παραγώγων επί επιτοκίων και συναλλάγματος.</p>	{CURRENCYCODE_3}
31	Ένδειξη τιμής	Δηλώνεται αν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία, ως ποσοστό, ως απόδοση ή ως μονάδες βάσης.	<p>«MONE» — Χρηματική αξία</p> <p>«PERC» — Ποσοστό</p> <p>«YIEL» — Απόδοση</p> <p>«BAPO» — Μονάδες βάσης</p>

Τμήμα I — Οδηγίες για εντολές

32	Δείκτης αγοράς-πώλησης	<p>Για να δηλώνεται αν η εντολή είναι εντολή αγοράς ή πώλησης.</p> <p>Στην περίπτωση δικαιωμάτων προαίρεσης και δικαιωμάτων προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής (swaptions), αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που έχει το δικαίωμα να ασκήσει το δικαίωμα προαίρεσης και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί το δικαίωμα προαίρεσης και λαμβάνει την τιμή δικαιώματος (πριμ).</p> <p>Στην περίπτωση συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης και προθεσμιακών συμβάσεων, εκτός αυτών που αφορούν συνάλλαγμα, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που αγοράζει το μέσο και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί το μέσο.</p> <p>Στην περίπτωση συμφωνιών ανταλλαγής που αφορούν τίτλους, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που αναλαμβάνει τον κίνδυνο διακύμανσης της τιμής του υποκείμενου τίτλου και λαμβάνει το ποσό του τίτλου. Πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το ποσό του τίτλου.</p>	<p>«BUYI» — αγορά</p> <p>«SELL» — πώληση</p>
----	------------------------	---	--

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
		<p>Στην περίπτωση συμφωνιών ανταλλαγής που αφορούν επιτόκια ή δείκτες πληθωρισμού, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το σταθερό επιτόκιο. Πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το σταθερό επιτόκιο. Στην περίπτωση βασικών συμφωνιών ανταλλαγής (συμφωνιών ανταλλαγής κυμαινόμενων επιτοκίων), αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει τη διαφορά τιμής (άνοιγμα) και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει τη διαφορά τιμής (άνοιγμα).</p> <p>Στην περίπτωση συμφωνιών ανταλλαγής και προθεσμιακών συμβάσεων που αφορούν συνάλλαγμα και διασυναλλαγματικών συμφωνιών ανταλλαγής, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το νόμισμα το οποίο εμφανίζεται πρώτο κατά την αλφαβητική κατάταξη σύμφωνα με το πρότυπο ISO 4217 και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το νόμισμα αυτό.</p> <p>Στην περίπτωση συμφωνιών ανταλλαγής που αφορούν μερίσματα, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει τις ισοδύναμες καταβολές πραγματικών μερισμάτων. Πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το μέρισμα και λαμβάνει το σταθερό επιτόκιο.</p> <p>Στην περίπτωση παραγώγων μέσων για τη μεταβίβαση πιστωτικού κινδύνου, με την εξαίρεση δικαιωμάτων προαίρεσης και δικαιωμάτων προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που αγοράζει την προστασία. Πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί την προστασία.</p> <p>Στην περίπτωση συμβάσεων παραγώγων που αφορούν βασικά εμπορεύματα ή δικαιώματα εκπομπής, αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το βασικό εμπόρευμα ή τα δικαιώματα εκπομπής που προσδιορίζονται στην έκθεση και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που παραδίδει αυτό το βασικό εμπόρευμα ή τα δικαιώματα εκπομπής.</p> <p>Στην περίπτωση προθεσμιακών συμβάσεων επιτοκίου (forward rate agreements), αγοραστής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το σταθερό επιτόκιο και πωλητής είναι ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το σταθερό επιτόκιο.</p> <p>Στην περίπτωση αύξησης της ονομαστικής αξίας, αγοραστής είναι ο ίδιος με τον αγοραστή του χρηματοπιστωτικού μέσου στην αρχική συναλλαγή και πωλητής είναι ο ίδιος με τον πωλητή του χρηματοπιστωτικού μέσου στην αρχική συναλλαγή.</p> <p>Στην περίπτωση μείωσης της ονομαστικής αξίας, αγοραστής είναι ο ίδιος με τον πωλητή του χρηματοπιστωτικού μέσου στην αρχική συναλλαγή και πωλητής είναι ο ίδιος με τον αγοραστή του χρηματοπιστωτικού μέσου στην αρχική συναλλαγή.</p>	
33	Κατάσταση εντολής	<p>Για την αναγνώριση εντολών που είναι ενεργές/ανεργές/υπό αναστολή, σταθερές/ενδεικτικές (αποδίδονται μόνον σε προσφορές τιμών)/έμμεσες/αναδρομολογημένες.</p> <p>Ενεργές — εντολές χωρίς προσφορά τιμής οι οποίες είναι διαπραγματεύσιμες.</p> <p>Ανεργές — εντολές χωρίς προσφορά τιμής οι οποίες δεν είναι διαπραγματεύσιμες.</p> <p>Σταθερές/ενδεικτικές (firm/indicative) — αποδίδονται μόνον σε προσφορές τιμής. Οι ενδεικτικές προσφορές τιμής είναι ορατές, αλλά δεν μπορούν να εκτελεστούν. Σε αυτές περιλαμβάνονται τίτλοι επιλογής (warrants) σε ορισμένους τόπους διαπραγμάτευσης. Οι σταθερές προσφορές τιμής μπορούν να εκτελεστούν.</p> <p>Έμμεσες (implicit) — χρησιμοποιείται για εντολές στρατηγικής που προέρχονται από λειτουργίες συνεπαγωγής («implied in» ή «implied out»).</p> <p>Δρομολογημένες — χρησιμοποιείται για εντολές που έχουν δρομολογηθεί από τον τόπο διαπραγμάτευσης προς άλλους τόπους.</p>	<p>«ACTI» — ενεργές ή «INAC» — ανεργές ή «FIRM» — σταθερές προσφορές τιμής ή «INDI» — ενδεικτικές προσφορές τιμής ή «IMPL» — συνεπαγόμενες εντολές στρατηγικής ή «ROUT» — δρομολογημένες εντολές.</p> <p>Εάν εφαρμόζονται πολλαπλές καταστάσεις, το παρόν πεδίο συμπληρώνεται με πολλαπλές σημάνσεις, οι οποίες χωρίζονται με κόμμα.</p>

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
34	Ένδειξη ποσότητας	Δηλώνεται αν η αναφερόμενη ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων, ως ονομαστική αξία ή ως χρηματική αξία.	«UNIT» — Αριθμός μονάδων «NOML» — Ονομαστική αξία «MONE» — Χρηματική αξία
35	Νόμισμα ποσότητας	Το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται η ποσότητα. Το πεδίο χρειάζεται να συμπληρώνεται μόνον όταν η ποσότητα εκφράζεται ως ονομαστική ή χρηματική αξία.	{CURRENCYCODE_3}
36	Αρχική ποσότητα	Ο αριθμός των μονάδων του χρηματοπιστωτικού μέσου ή ο αριθμός των συμβάσεων παραγώγων στην εντολή. Η ονομαστική ή χρηματική αξία του χρηματοπιστωτικού μέσου. Στην περίπτωση τοποθετήσεων επί χρηματοπιστωτικών διαφορών (spread bets), η ποσότητα είναι η χρηματική αξία που στοιχηματίζεται ανά μοναδιαία διακύμανση του υποκείμενου χρηματοπιστωτικού μέσου. Στην περίπτωση αύξησης ή μείωσης σε ονομαστικές συμβάσεις παραγώγων, ο αριθμός αποτυπώνει την απόλυτη τιμή της μεταβολής και εκφράζεται ως θετικός αριθμός. Στην περίπτωση συμβολαίων ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS), η ποσότητα είναι το ονομαστικό ποσό για το οποίο αγοράζεται ή πωλείται η προστασία.	{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} σε περίπτωση που η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.
37	Εναπομείνουσα ποσότητα, συμπεριλαμβανομένης της κρυφής ποσότητας	Η συνολική ποσότητα που απομένει στο βιβλίο εντολών μετά από μερική εκτέλεση ή στην περίπτωση οποιουδήποτε άλλου συμβάντος που επηρεάζει την εντολή. Στην περίπτωση μερικής εκτέλεσης, είναι ο συνολικός εναπομείνουσος όγκος μετά την εν λόγω μερική εκτέλεση. Κατά την καταχώριση μιας εντολής, ισούται με την αρχική ποσότητα.	{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.
38	Εμφανιζόμενη ποσότητα	Η ποσότητα που είναι ορατή (σε αντίθεση με την κρυφή) στο βιβλίο εντολών.	{DECIMAL-18/17} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.
39	Ποσότητα διαπραγματεύσεως	Στην περίπτωση μερικής ή ολικής εκτέλεσης, το παρόν πεδίο συμπληρώνεται με την ποσότητα εκτέλεσης.	{DECIMAL-18/17} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.
40	Ελάχιστη αποδεκτή ποσότητα (MAQ)	Η ελάχιστη αποδεκτή ποσότητα για την εκτέλεση μιας εντολής, η οποία μπορεί να αποτελείται από περισσότερες από μία μερικές εκτελέσεις και συνήθως αφορά μόνον μη πάγια είδη εντολών. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.	{DECIMAL-18/17} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
41	Ελάχιστο εκτελέσιμο μέγεθος (MES)	Το ελάχιστο μέγεθος εκτέλεσης οποιασδήποτε μεμονωμένης δυνητικής εκτέλεσης. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.	{DECIMAL-18/17} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} όταν η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.
42	Ελάχιστο εκτελέσιμο μέγεθος πρώτης εκτέλεσης μόνον	Διευκρινίζεται αν το MES αφορά μόνον την πρώτη εκτέλεση. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται, εάν το πεδίο 41 δεν συμπληρώνεται επίσης.	«true» (σωστό) «false» (λάθος)
43	Δείκτης παθητικής εκτέλεσης μόνον	Δηλώνεται αν η εντολή υποβάλλεται στον τόπο διαπραγμάτευσης με χαρακτηριστικό/σήμανση, ώστε η εντολή να μην εκτελείται αμέσως έναντι οποιωνδήποτε αντίθετων ορατών εντολών.	«true» (σωστό) «false» (λάθος)
44	Δείκτης παθητικής ή επιθετικής εντολής	Στην περίπτωση συμβάντων μερικής εκτέλεσης και εκτέλεσης εντολών, δηλώνεται αν η εντολή βρισκόταν ήδη στο βιβλίο εντολών και παρέιχε ρευστότητα (παθητική) ή αν η εντολή ξεκίνησε τη διαπραγμάτευση και, επομένως, έλαβε ρευστότητα (επιθετική). Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.	«PASV» — παθητική ή «AGRE» — επιθετική.
45	Πρόληψη αυτοεκτέλεσης (self-execution)	Δηλώνεται αν η εντολή έχει καταχωριστεί με κριτήρια πρόληψης της αυτοεκτέλεσης και, επομένως, δεν θα εκτελεστεί έναντι εντολής στην απέναντι πλευρά του βιβλίου την οποία καταχωρίζει το ίδιο μέλος ή ο ίδιος συμμετέχων.	«true» (σωστό) «false» (λάθος)
46	Αναγνωριστικό εντολής συνδεδεμένης με στρατηγική	Ο αλφαριθμητικός κωδικός που χρησιμοποιείται για τη σύνδεση όλων των συνδεδεμένων εντολών που αποτελούν μέρος στρατηγικής, σύμφωνα με το άρθρο 7 παράγραφος 2.	{ALPHANUM-50}
47	Στρατηγική δρομολόγησης	Η εφαρμοστέα στρατηγική δρομολόγησης σύμφωνα με τις προδιαγραφές του τόπου διαπραγμάτευσης. Το παρόν πεδίο δεν συμπληρώνεται εάν είναι άνευ αντικειμένου.	{ALPHANUM-50}
48	Αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής του τόπου διαπραγμάτευσης	Αλφαριθμητικός κωδικός που αποδίδεται από τον τόπο διαπραγμάτευσης στη συναλλαγή, σύμφωνα με το άρθρο 12 του παρόντος κανονισμού. Ο αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής του τόπου διαπραγμάτευσης είναι μοναδικός, ομοιόμορφος και σταθερός ανά κωδικό MIC τμήματος, σύμφωνα με το πρότυπο ISO10383, και ανά ημέρα διαπραγμάτευσης. Εάν ο τόπος διαπραγμάτευσης δεν χρησιμοποιεί κωδικούς MIC τμήματος, ο αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής του τόπου διαπραγμάτευσης είναι μοναδικός, ομοιόμορφος και σταθερός ανά κωδικό MIC λειτουργίας ανά ημέρα διαπραγμάτευσης. Τα συστατικά στοιχεία του αναγνωριστικού κωδικού συναλλαγής δεν αποκαλύπτουν την ταυτότητα των αντισυμβαλλομένων της συναλλαγής στην οποία αποδίδεται ο κωδικός.	{ALPHANUM-52}

Αρ.	Πεδίο	Περιεχόμενο των λεπτομερών στοιχείων των εντολών τα οποία πρέπει να είναι στη διάθεση της αρμόδιας αρχής	Πρότυπα και μορφότυποι των λεπτομερών στοιχείων των εντολών που πρέπει να χρησιμοποιούνται κατά την παροχή των σχετικών δεδομένων εντολών στην αρμόδια αρχή κατόπιν αιτήματος
-----	-------	--	---

Τμήμα ΙΑ — Φάσεις διαπραγμάτευσης, ενδεικτική τιμή δημοπρασίας και ενδεικτικός όγκος δημοπρασίας

49	Φάσεις διαπραγμάτευσης	Το όνομα καθεμιάς από τις διάφορες φάσεις διαπραγμάτευσης κατά τη διάρκεια της οποίας υπάρχει στο βιβλίο εντολών μια εντολή, συμπεριλαμβανομένων περιόδων παύσης, διακοπής και αναστολής της διαπραγμάτευσης.	{ALPHANUM-50}
50	Ενδεικτική τιμή δημοπρασίας	Η τιμή στην οποία πρόκειται να κλείσει κάθε δημοπρασία αναφορικά με το χρηματοπιστωτικό μέσο για το οποίο έχουν δοθεί μία ή περισσότερες εντολές.	{DECIMAL-18/5} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία. Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος. {DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση.
51	Ενδεικτικός όγκος δημοπρασίας	Ο όγκος (αριθμός μονάδων του χρηματοπιστωτικού μέσου) που μπορεί να εκτελεστεί στην ενδεικτική τιμή δημοπρασίας στο πεδίο 50, εάν η δημοπρασία ολοκληρωνόταν ακριβώς κατά τη συγκεκριμένη χρονική στιγμή.	{DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η ποσότητα εκφράζεται ως αριθμός μονάδων. {DECIMAL-18/5} σε περίπτωση που η ποσότητα εκφράζεται ως χρηματική ή ονομαστική αξία.