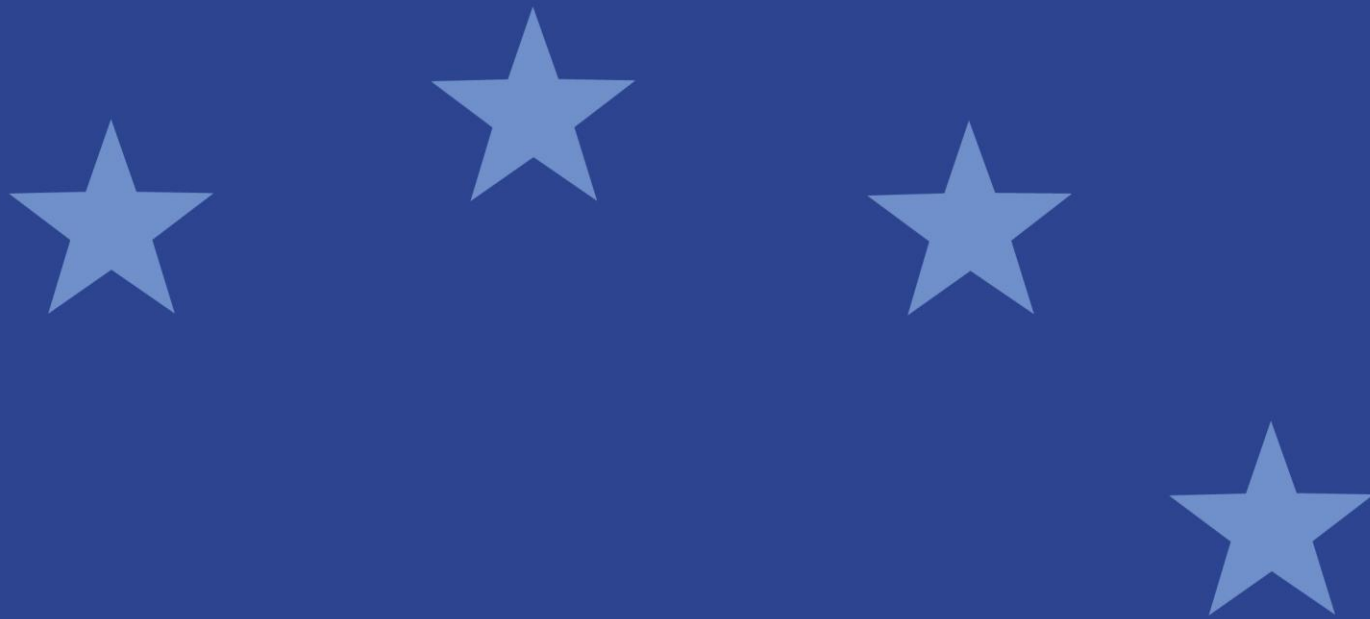


Riktlinjer

Transaktionsrapportering, registerföring av order och klocksynkronisering enligt MiFID II



Innehåll

Innehåll	3
Sammanfattning	9
1 Tillämpningsområde	10
2 Definitioner	10
3 Syfte	10
4 Efterlevnad och rapporteringsskyldigheter	11
5 Riktlinjer om transaktionsrapportering	11
Del I – Allmänna principer	14
5.1 Allmänt tillvägagångssätt vid rapportering	14
5.2 Handelskapacitet	15
5.2.1 Handel för egen räkning (DEAL)	16
5.2.2 Handel med matchad principal handelskapacitet (MTCH)	19
5.2.3 Handel enligt "annan kapacitet" (AOTC)	20
5.2.4 Begränsningar av handelskapaciteten	21
5.3 Kedjor och vidarebefordran	21
5.3.1 Allmänt	21
5.3.2 Kedja där ett företag handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet	22
5.3.3 Vidarebefordran	22
5.4 Utförande av en transaktion på en handelsplats	24
5.4.1 Identifieringskod för handelsplatstransaktioner (fält 3)	24
5.4.2 Rapportering av fältet avseende handelsplats för kedjor (fält 36)	24
5.5 Identifieringskoder för parterna	24
5.5.1 Förfarande för att generera CONCAT	25
5.5.2 Förnamn och efternamn	27
5.6 Innebörden av transaktion	28
5.6.1 Förvärv och avyttringar	28
5.6.2 Undantag från rapportering	28
5.7 Rapporteringsmekanismer	33
5.7.1 Fält som inte är tillämpliga och ifyllande av fält för instrumentreferensuppgifter	33
5.7.2 Inlämnande av transaktionsrapporter	34
Del II – Block	34
5.8 Block 1: Identifiering av köpare/säljare	34
5.8.1 Köpare/säljare som är berättigad till LEI	35
5.8.2 Köparen/säljaren är en fysisk person	35

5.9	Block 2: Köparens/säljarens beslutfattare	39
5.9.1	Köparen/säljaren är beslutsfattare.....	40
5.9.2	Beslutsfattaren är en tredje part med befogenhet att företräda köparen/säljaren.....	40
5.10	Block 3 (kombination av 1 och 2): Särskilda scenarier för köpare/säljare och beslutsfattare	42
5.10.1	Köpare/säljare är ett gemensamt konto.....	42
5.10.2	Säljaren är avliden	44
5.11	Block 4: Fältet för investeringsbeslut inom företaget.....	44
5.11.1	Fältet för investeringsbeslut inom företaget	44
5.11.2	Investeringsbeslutet fattas utanför företaget (kunden fattar investeringsbeslutet och värdepappersföretaget handlar på grundval av en matchad principkapacitet eller annan kapacitet)45	
5.12	Block 5: Fältet för utförande inom företaget	46
5.12.1	En person har det huvudsakliga ansvaret för utförandet.....	46
5.12.2	En algoritm har det huvudsakliga ansvaret för utförandet.....	46
5.13	Block 6: Datum och tidpunkt för handel.....	47
5.14	Block 7: Handelsplats	47
5.14.1	Utförande av en transaktion i en anonym orderbok på en handelsplats	48
5.14.2	Utförande av en transaktion på en handelsplattform utanför unionen i en icke-anonym orderbok	49
5.14.3	Utförande av en transaktion på en handelsplats genom acceptering av sin egen order i en anonym orderbok	50
5.14.4	En systematisk internhandlare utför en transaktion	51
5.15	Block 8: Flagging för blankning	52
5.15.1	Kund till värdepappersföretag X utför en blankning (värdepappersföretag X har tillgång till denna information)	53
5.15.2	Värdepappersföretag X utför en blankning för egen räkning	53
5.16	Block 9: Uppgift om undantag, transparens efter handel för OTC och råvaruderivat	55
5.16.1	Uppgift om undantag och transparens efter handel för OTC	55
5.16.2	Uppgift om transparens efter handel när ett värdepappersföretag matchar två kundorder OTC	59
5.16.3	Uppgift om råvaruderivat	59
5.17	Block 10: Filialer	60
5.17.1	Transaktion som utförs för en kunds räkning	60
5.17.2	Transaktion som utförs för egen räkning	62
5.17.3	Transaktion som utförs av EES-filialer till företag som inte tillhör EES	64
5.18	Block 11: Transaktionsrapporternas status och rättelser	65
5.18.1	Annulleringar och ändringar intradag	66
5.18.2	Inlämnande av en ny transaktionsrapport	66

5.18.3	Inlämnande av en annullering	67
5.18.4	Rättelse av informationen i en transaktionsrapport	68
5.19	Block 12: Teoretisk ändring	69
5.19.1	Teoretisk ökning	69
5.19.2	Teoretisk minskning	72
5.19.3	Fullständig uppsägning i förtid	74
Del III – Handelsscenarier		74
5.20	Överföring av värdepapper	74
5.20.1	Överföring mellan kunder inom samma företag	74
5.20.2	Överföring mellan kunder från två separata värdepappersföretag	76
5.20.3	Företag som handlar OTC för att matcha två kundorder	77
5.21	Värdepappersföretag som förmedlar utan att träda emellan	80
5.21.1	Värdepappersföretag som matchar två order från kunder utan att träda emellan själva	80
5.21.2	Värdepappersföretag som förmedlar sin kund till ett annat värdepappersföretag utan att självt träda emellan	81
5.22	En order för en kund som utförs genom flera transaktioner	82
5.22.1	Fyllande av kundens order genom utförande på en handelsplats och sedan tillhandahållande till kunden från värdepappersföretagets egen bok	82
5.22.2	Fyllande av kundens order genom erhållande av en del från en handelsplats och tillhandahållande av instrumenten till kunden från värdepappersföretagets egen bok	85
5.23	Ackumulering av order	87
5.23.1	Ett utförande på marknaden för flera kunder	88
5.23.2	Flera utföranden på marknaden för flera kunder	91
5.24	OTF som handlar på grundval av matchad principalkapacitet	105
5.25	Värdebaserade transaktioner med en balanserande enhet	111
5.26	Kedjor och vidarebefordran	115
5.26.1	Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b inte är uppfyllda	116
5.26.2	Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b är uppfyllda men inte alla andra villkor som fastställs i artikel 4	119
5.26.3	Kedjor där villkoren som föreskrivs i artikel 4 i RTS 22 uppfylls av alla värdepappersföretag	128
5.26.4	Kedjor där de villkor som fastställs i artikel 4 i RTS 22 uppfylls av några värdepappersföretag i kedjan	136
5.27	Värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder	150
5.27.1	Värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder utan att uppfylla villkoren för vidarebefordran (kombination av ackumulerade order och kedjor/vidarebefordran)	150

5.27.2	Fondförvaltare som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder och uppfyller villkoren för vidarebefordran	163
5.28	Direkt elektronisk åtkomst (DEA).....	171
5.28.1	Scenario 1: DEA-kunden handlar för egen räkning utan någon underliggande kund .	171
5.28.2	Scenario 2: DEA-kunden handlar för en kunds räkning	173
5.29	Säkring genom kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)	177
5.30	Rapportering från en handelsplats om en transaktion som utförs genom dess system enligt artikel 26.5 i MiFIR.....	179
5.30.1	Företag som handlar för egen räkning	180
5.30.2	Företaget handlar på grundval av matchad principalkapacitet eller enligt "annan kapacitet" för en enskild kunds räkning	181
5.30.3	Företag ackumulerar order från flera kunder.....	182
5.31	Transaktioner för värdepappersfinansiering	184
DEL IV – Rapportering av olika slags instrument		185
5.32	Principer	185
5.33	Identifiering av finansiella instrument som handlas på en handelsplats eller som är tillgängliga i Esmas förteckning	185
5.34	Identifiering av finansiella instrument som inte handlas på en handelsplats eller är tillgängliga i Esmas förteckning	186
5.34.1	Finansiella instrument som handlas på en organiserad handelsplattform utanför unionen (handelsplats utanför EES).....	186
5.34.2	OTC-derivat	187
5.35	Rapportering av särskilda finansiella instrument.....	188
5.35.1	Aktier eller aktieliknande instrument.....	188
5.35.2	Obligationer eller andra former av skuldförbindelser.....	189
5.35.3	Kontrakt avseende prisdifferenser (CFD)	199
5.35.4	Spreadbetting	200
5.35.5	Kreditswap	206
5.35.6	Swappar.....	207
5.35.7	Råvarubaserade derivat	224
5.35.8	Komplex handel	229
6	Riktlinjer för registerföring av order	233
Del I – Allmänna principer		233
6.1	Tillämpningsområde för kraven på registerföring av order.....	233
6.2	Medlemmar eller deltagare i en handelsplats.....	233
6.3	Identifieringskod för kund (fält 3)	233
6.3.1	Ifyllande av fält 3 (identifieringskod för kund) vid ackumulerade order	234
6.3.2	Ifyllande av fält 3 (identifieringskod för kund) i avvaktan på tilldelning.....	234

6.4	Icke-verkställande mäklare (fält 6).....	234
6.5	Orderstatus (fält 33).....	235
6.6	Giltighetsperiod och tidpunkt (fält 12).....	235
6.7	Passiv eller aggressiv indikator (fält 44).....	236
6.8	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner (fält 48).....	236
6.9	Ordningsnummer (fält 15).....	236
6.10	Giltighetsperiod/standardiserad tidsstämpel (fält 10)	239
6.10.1	Giltig-under-dagen-flaggning (DAVY).....	239
6.10.2	Kombination av flaggor för två giltighetsperioder: Giltig efter tidpunkt (GADV) och giltig till datum (GTDV).....	239
6.11	Tillhandahållande av likviditet (fält 8)	241
Del II – Scenarier		242
6.12	Förklaring	242
6.13	Central orderbok för limiterade order	242
6.13.1	Ny/annullering/modifiering av order (fält 21)	243
6.13.2	Ytterligare gränspis (fält 25)	246
6.13.3	Klassificering av en limiterad isbergsorder	247
6.13.4	Peggade order	250
6.13.5	Klassificering av en stopporder	254
6.13.6	Dirigerade order.....	256
6.13.7	Klassificering av strategiska order (fält 46)	263
6.13.8	Ändrad prioritet	276
6.13.9	Handelsfaser.....	280
6.14	RFQ-system (request for quote).....	290
6.14.1	Registrering av en anbudsförfrågan som skickas till särskilda motparter	291
6.14.2	Registrering av ett bud till följd av en anbudsförfrågan med begränsad giltighetstid ("måste antas direkt") som endast är verkställbart för den särskilda aktör som lämnat anbudsförfrågan.....	292
6.14.3	Registrering av ett bud till följd av en anbudsförfrågan med en annan kvantitet än den efterfrågade	293
6.14.4	Registrering av ett genomförande i ett RFQ-system	294
7	Riktlinjer om klocksynkronisering	296
7.1	Händelser som ska rapporteras	296
7.2	Granularitet för tidsstämpel	296
7.3	Efterlevnad av kraven på största godtagbara avvikelse	299
7.3.1	Skottsekunder	300
7.3.2	Lokal tid och avvikelse från UTC	300

7.3.3	Tillämpning på värdepappersföretag som inte är direkta medlemmar eller deltagare i handelsplatsen.....	300
7.4	Tillämpnings- och värdtidstämplar samt elektroniska tidsstämplar	301
7.5	Latens från gateway till gateway	301
8	Bilagor.....	301
	Bilaga I Behandling av rapporter som erhålls från inlämnande enheter	301

Sammanfattning

Skäl för publicering

Efter slutförandet av förslaget till tekniska standarder för tillsyn av transaktionsrapportering, registerföring av order och klocksynchronisering (kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 och kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574¹) har Esma på eget initiativ inlett arbetet med att vidta åtgärder för en samstämmig övervakning av genomförandet av dessa standarder.

Dessa riktlinjer återspeglar resultatet av detta arbete och följer det samrådsdokument som publicerades i december 2015².

Innehåll

I avsnitten 1, 2 och 3 fastställs riktlinjernas tillämpningsområde, definitioner och syfte. I avsnitt 4 fastställs förfarandet för efterlevnaden av riktlinjerna. I avsnitten 5 och 6 fastställs individuella scenarier som är tillämpliga på en viss transaktion och åtgärd för registerföring av order. Vart och ett av dessa scenarier åtföljs av den exakta tekniska instruktionen för programmering som ska användas för att återge de särskilda värden som ska rapporteras. Utöver scenarierna rörande rapportering och bokföring tillhandahålls i dessa avsnitt även ett antal ytterligare klargöranden avseende tillämpningen av kraven enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 och kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 som efterfrågades av marknadsaktörerna under samrådet om dessa standarder, men som inte kunde behandlas i de slutgiltiga tekniska standarderna på grund av förfrågningarnas detaljnivå och särdrag. I avsnitt 7 klargörs tillämpningen av kraven på synkronisering av klockor (kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574).

¹ Esmas förslag till tekniska standarder ingavs till Europeiska kommissionen den 28 september 2015 (ESMA/2015/1464) och är tillgängliga på Esmas webbplats på följande länk: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1464_annex_i_-_draft_rts_and_its_on_mifid_ii_and_mifir.pdf

² Samrådsdokument om riktlinjer för transaktionsrapportering, referensuppgifter, registerföring av order och klocksynchronisering (ESMA/2015/1909) är tillgängligt på Esmas webbplats på följande länk: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015-1909_guidelines_on_transaction_reporting_reference_data_order_record_keeping_and_clock_synchronisation.pdf

1 Tillämpningsområde

Vem?

Dessa riktlinjer ska gälla för värdepappersföretag, handelsplatser, godkända rapporteringsmekanismer (ARM) och behöriga myndigheter.

Vad?

Dessa riktlinjer är tillämpliga med avseende på transaktionsrapporter som lämnas in enligt artikel 26 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 (MiFIR)³, registerföring av order enligt artikel 25 i MiFIR och synkronisering av klockor enligt artikel 50 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU (MiFID II)⁴.

När?

Dessa riktlinjer är tillämpliga från och med den 3 januari 2018.

2 Definitioner

De definitioner som används i MiFID II och MiFIR har samma betydelse i dessa riktlinjer. Hänvisningar till "företag" i dessa riktlinjer avser alla företag som inte är "värdepappersföretag" i den mening som avses i MiFID II, såvida inte annat anges.

Hänvisningar till ett särskilt "fält" i riktlinjerna om transaktionsrapportering hänför sig till fälten i tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590⁵ och i riktlinjerna om registerföring av order i fälten i tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580⁶.

3 Syfte

Syftet med dessa riktlinjer är att tillhandahålla vägledning till värdepappersföretag⁷, handelsplatser⁸, ARM⁹ och systematiska internhandlare (SI)¹⁰ om efterlevnad av bestämmelserna om rapportering och registerföring av order i MiFIR och kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 och kommissionens delegerade förordning (EU)

³ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (EUT L 173, 12.6.2014, s. 84).

⁴ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

⁵ KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/590 av den 28 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder för rapportering av transaktioner till behöriga myndigheter. Finns på följande länk:

http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0449.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC

⁶ KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/580 av den 24 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller bevarande av relevanta uppgifter om order som avser finansiella instrument. Finns på följande länk:

http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0193.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC

⁷ Enligt definitionen i artikel 4.1.1 i MiFID II.

⁸ Enligt definitionen i artikel 4.1.24 i MiFID II.

⁹ Enligt definitionen i artikel 4.1.54 i MiFID II.

¹⁰ Enligt definitionen i artikel 4.1.20 i MiFID II.

2017/574¹¹. De är utformade för att säkerställa en enhetlig tillämpning av dessa krav. I riktlinjerna ligger fokus särskilt på upprättandet av transaktionsrapporter och registreringen av orderdata för varje enskilt fält för olika scenarier som kan uppkomma. Med hänsyn till det stora antalet möjliga scenarier tillhandahåller dessa riktlinjer inte någon uttömmande förteckning över samtliga scenarier. De personer som omfattas av dessa riktlinjer ska tillämpa delar från det mest relevanta scenariot för att upprätta sina register och rapporter. Alla begrepp som specificeras i det vägledande dokumentet är enbart tillämpliga på artikel 25 i MiFIR om skyldigheter att registrera orderdata, artikel 26 i MiFIR om skyldighet att rapportera transaktioner och artikel 50 i MiFID II om synkronisering av klockor.

Alla för- och efternamn som används i dessa riktlinjer är påhittade.

4 Efterlevnad och rapporteringsskyldigheter

Riktlinjernas status

Detta dokument innehåller riktlinjer som antagits enligt artikel 16 i Esma-förordningen. Enligt artikel 16.3 i Esma-förordningen ska de behöriga myndigheterna och finansmarknadsaktörerna med alla tillgängliga medel söka följa riktlinjerna och rekommendationerna.

Behöriga myndigheter som omfattas av riktlinjerna ska följa dem genom att inkludera dem i sin tillsynspraxis, inbegripet när särskilda riktlinjer i dokumentet främst riktar sig till finansmarknadsaktörer.

Rapporteringskrav

Behöriga myndigheter som omfattas av riktlinjerna ska meddela Esma huruvida de följer eller tänker följa riktlinjerna och ange skäl om de inte följer dem, inom två månader från det att Esma har offentliggjort dem, till MiFIRreportingGL@esma.europa.eu. I avsaknad av svar inom denna frist anses de behöriga myndigheterna inte följa riktlinjerna. En mall för meddelanden är tillgänglig på Esmas webbplats.

Finansmarknadsaktörer är inte skyldiga att rapportera om de följer dessa riktlinjer.

5 Riktlinjer om transaktionsrapportering

Detta avsnitt om transaktionsrapportering är uppdelat i fyra delar:

- **Del I – Allmänna principer.** Här beskrivs de allmänna principer som är tillämpliga vid transaktionsrapportering. Denna del omfattar utformningen av en transaktionsrapport och under vilka omständigheter och vart rapporten ska skickas. Här tillhandahålls tillvägagångssätt för rapportering på övergripande nivå och ytterligare vägledning om vissa undantag från begreppet "transaktion" såsom det specificeras i artikel 2.5 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.
- **Del II – Block.** Denna del omfattar block (en samling fält), där varje block är tillämpligt på det relevanta fältet avseende ett visst ämne, med tillhörande exempel på hur dessa ska fyllas i. Blocken är utformade för att vara oberoende av varandra.

¹¹ KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/574 av den 7 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller noggrannhetsnivån för klockor.

- **Del III – Scenarier.** Här tillhandahålls exempel som är baserade på vissa handelsscenarier som en rapporterande part kan stöta på. Särskilt presenteras transaktioner som uppkommer vid vidarebefordran av order, gruppering av order och bestämmelserna om direkt elektronisk åtkomst (DEA).
- **Del IV – Instrument.** Här ligger fokus på riktlinjer för rapportering av olika slags finansiella instrument¹². De flesta exempel fokuserar på derivat, eftersom dessa finansiella instrument har ett mer komplext rapporteringsmönster.

För varje exempel i detta dokument finns en motsvarande tabell med relevanta fält och den förväntade XML-text som uppkommer från dessa uppgifter. Den motsvarande tabellen och XML ska tolkas på följande sätt, såvida inget annat anges:

- a) "N" och "fält" motsvarar numret och namnet på fälten i tabell 2, bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.
- b) Kolumnen "värden" innehåller det förväntade variabla värdet i exemplet. Variabla värden omges av citattecken. I vissa fall visas i stället ett beskrivande värde, t.ex. "{LEI}" för företaget X". Dessa värden ska bytas ut mot ett faktiskt värde som motsvarar beskrivningen. Vid hänvisningar kan värdena från de fiktiva enheterna i förklaringen tillämpas på XML. Uppgifter inom parentes avser de typer av uppgifter som beskrivs i tabell 1, bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.
- c) Luckor i kolumnen "värden" visar uttryckligen att dessa fält inte är tillämpliga och inte ska fyllas i avseende det särskilda scenario som illustreras.

Utdrag från XML-text tillhandahålls för att illustrera hur uppgifterna ska behandlas i den fil som lämnas in till den behöriga myndigheten. För att genomföra metoderna i ISO 20022 ska emellertid meddelandenas fullständiga tekniska specifikation tillämpas och endast den fullständiga tekniska specifikation som är tillgänglig på https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf ska anses utgöra den korrekta specificeringen av meddelanden.

Alla instrument som det hänvisas till i exemplen är finansiella instrument som ska rapporteras enligt artikel 26.2 i MiFIR.

Rapporteringen visas enbart för de parter som behandlas i det relevanta exemplet och ska inte tolkas som att andra parter i sådana exempel inte är skyldiga att rapportera transaktioner.

Alla klockslag är i UTC om inte annat anges. Datum och klockslag visas med den minsta granularitet som krävs enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (bilaga I, tabell 2, fält 28) och får rapporteras med högre granularitet såsom förklaras i avsnitt 7.2 om granularitet för tidsstämpel.

All handel antas vara elektronisk handel men inte högfrekvenshandel vad gäller frågan med vilken granularitet tiden ska rapporteras.

Det eller de värdepappersföretag vars rapporter visas handlar enligt "annan kapacitet", såvitt inget annat uttryckligen anges.

Förklaring:

Företag X (LEI: 12345678901234567890) är ett värdepappersföretag.

¹² Enligt definitionen i artikel 4.1.15 i MiFID II.

Företag Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) är ett värdepappersföretag.

Företag Z (LEI: 88888888888888888888888888888888) är ett värdepappersföretag.

Kund A (LEI: AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA) är en juridisk person.

Kund B (LEI: BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB) är en juridisk person.

Kund C (LEI: CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) är en juridisk person.

Handelsplats M (MIC-segment: "XMIC"). Denna handelsplats förvaltar en anonym orderbok med en central motpart (CCP) vars LEI är 11111111111111111111.

Kund 1: fysisk person, Jean Cocteau, fransk medborgare, födelsedatum den 4 juni 1962 (CONCAT: FR19620604JEAN#COCTE).

Kund 2: fysisk person, Jose Luis Rodriguez de la Torre, spansk medborgare, födelsedatum den 27 februari 1976. Jose Luis Rodriguez de la Torres spanska skatteregistreringsnummer är 99156722T.

Företrädare 1: fysisk person, Fabio Luca, italiensk medborgare med skattekod ABCDEF1234567890 och födelsedatum den 11 oktober 1974.

Handlare 1: Peter Morgan, kanadensisk medborgare (passnummer 1112223334445555) som handlar för företag X.

Handlare 2: Peter Jones, brittisk medborgare med brittiskt nationellt försäkringsnummer AB123456C, som handlar för företag X.

Handlare 3: John Cross, belgisk medborgare med nationellt nummer 12345678901, som handlar för företag X.

Handlare 4: Marie Claire, fransk medborgare, födelsedatum den 2 december 1963 (CONCAT FR19631202MARIECLAIR), som handlar för företag Y.

Handlare 5: Juliet Stevens, finsk medborgare, personbeteckning 311280-888Y, som handlar för företag Z.

Handlare 6: Adam Jones, ungersk medborgare, födelsedatum den 13 april 1980 (CONCAT HU19800413ADAM#JONES), som handlar för företag Z.

För att spara plats och fokusera på de huvudpunkter som illustreras genom exemplen är det viktigt att betona att alla exempel med deras motsvarande tabell och XML endast berör vissa av de fält som faktiskt krävs enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Fält som inte särskilt omnämns i ett exempel kan inte antas sakna betydelse. Alla fält som är relevanta för en faktisk transaktion ska rapporteras.

För att säkerställa korrekt transaktionsrapportering ska detta dokument läsas tillsammans med de relevanta bestämmelserna i MiFID II, MiFIR samt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 och kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574. Esmas och behöriga myndigheter får även offentliggöra tekniska specifikationer.

Del I – Allmänna principer

5.1 Allmänt tillvägagångssätt vid rapportering

Syftet med transaktionsrapportering är att tillhandahålla information om transaktioner till de behöriga myndigheterna. Syftet är att ge den behöriga myndigheten en bild av transaktionen genom vilken den får information om alla relevanta omständigheter under vilka transaktionen ägde rum. Beroende på värdepappersföretagets handelskapacitet och huruvida det handlar för en kund eller inte, kan det hända att en transaktion ska rapporteras i mer än en rapport.

För att kunna uppfylla de skyldigheter som anges i skäl 32 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 krävs att behöriga myndigheter får en konkret och heltäckande bild över transaktioner som omfattas av rapporteringskraven enligt artikel 26 i MiFIR. Såsom anges i skäl 11 och specificeras ytterligare i artikel 15.5 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska ett värdepappersföretag således säkerställa att en samlad bedömning av de transaktionsrapporter som ingetts av värdepappersföretaget i egenskap av den utförande enheten korrekt återspeglar alla ändringar i dess och dess kunders position som hänför sig till transaktioner som ska rapporteras¹³ i det aktuella finansiella instrumentet vid den tidpunkt som transaktionerna genomfördes. Om ett värdepappersföretag till exempel förvärvar några finansiella instrument för egen räkning och sedan säljer samma mängd instrument till sin kund ska det framgå av värdepappersföretagets rapporter att nettoförändringen för värdepappersföretaget är noll och att kunden har förvärvat instrumenten. Denna princip är tillämplig oavsett huruvida värdepappersföretaget självt, en behörig myndighet eller en handelsplats lämnar in någon eller alla rapporter. Till exempel ska ett värdepappersföretag som förlitar sig på att en handelsplats rapporterar informationen om marknadssidan från en transaktion inte lämna in någon transaktionsrapport för samma marknadssida. Om transaktionen genomförs för en kund ska ett värdepappersföretag, i enlighet med dessa riktlinjer, inte lämna in en separat transaktionsrapport för transaktionen med antingen en matchad principalkapacitet eller i "annan kapacitet", eftersom detta leder till en artificiell ökning av antalet transaktioner som detta värdepappersföretag rapporteras ha genomfört. Dessutom ska individuella rapporter från ett värdepappersföretag vara samstämmiga och på ett korrekt sätt spegla rollerna hos värdepappersföretaget, dess motparter, kunder och parter som handlar för kundernas räkning med befogenhet att företräda dem.

Enligt artikel 26.1 i MiFIR ska värdepappersföretag som genomför transaktioner med finansiella instrument lämna fullständiga och korrekta uppgifter om sådana transaktioner. Detta innebär att om två värdepappersföretag handlar med varandra ska vart och ett upprätta sin egen transaktionsrapport som speglar transaktionen ur dess eget perspektiv. Samtidigt ska innehållet i följande fält (som beskriver de gemensamma objektiva elementen i den överenskomna transaktionen mellan de två värdepappersföretagen) matcha i de respektive motsvarande rapporterna från de två värdepappersföretagen: handelsplats¹⁴, datum och tidpunkt för handel¹⁵, kvantitet, kvantitetsvaluta, pris, prisvaluta, förskottsbetalning, valuta för förskottsbetalning och uppgifter om instrument, såvitt av betydelse.

¹³ Det ska påpekas att rapporteringskraven inte är avsedda att spegla den faktiska position som värdepappersföretaget eller dess kunder har. Av intresse är förändringar i positioner som beror på transaktioner som ska rapporteras.

¹⁴ För marknadssidan av transaktioner som genomförs på en handelsplats (dvs. till skillnad från den därmed sammanhängande tilldelningen till kunden).

¹⁵ Med beaktande av de olika kraven på granularitet som är tillämpliga på värdepappersföretag – se avsnitt 7.2.

Transaktionsrapporter från ett värdepappersföretag ska inte enbart innehålla information om marknadssidan av transaktionen utan även information om sammanhängandetilldelningen till kunden, om detta är tillämpligt. Exempelvis, om värdepappersföretaget X som handlar för en kunds räkning förvärvar finansiella instrument från ett annat företag eller värdepappersföretag Y ska X rapportera att det har handlat med Y för X:s kund¹⁶. Om X köper finansiella instrument för egen räkning och säljer de aktuella finansiella instrumenten till en kund ska förvärvet från värdepappersföretag Y och försäljningen till kunden rapporteras i två separata transaktionsrapporter för egen räkning. Om ett värdepappersföretag på ett liknande sätt utför en transaktion med ett annat företag eller värdepappersföretag genom att ackumulera order från flera kunder ska det rapportera såväl den ackumulerade (block)handeln med företaget eller värdepappersföretaget (marknadssidan) som den individuella tilldelningen till sina kunder (kundsidan).

Till exempel, om ett värdepappersföretag handlar för en kund på en handelsplats för egen räkning ska det lämna in två transaktionsrapporter: en för transaktionen med handelsplatsen (marknadssidan) och en för transaktionen med kunden (kundsidan). Om ett värdepappersföretag handlar på grundval av en matchad principalkapacitet eller "annan kapacitet" för en enskild kund ska det inge en enda transaktionsrapport som innehåller både marknadssidan och kundsidan, och ska fylla i alla fält som är tillämpliga på kunden. Följande diagram illustrerar dessa begrepp:



Client	Kund
Client Side	Kundsida
Investment Firm X	Värdepappersföretag X
Market Side	Marknadssida
Investment Firm Y	Värdepappersföretag Y
Investment Firm Y executed on venue	Värdepappersföretag Y utförd på handelsplats
Trading venue	Handelsplats

5.2 Handelskapacitet

Såsom föreskrivs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (fält 29) finns det tre olika handelskapaciteter som kan rapporteras, nämligen handel för egen räkning, matchad principalkapacitet och "annan kapacitet". Den rapporterade handelskapaciteten ska spegla den kapacitet i vilken värdepappersföretaget faktiskt har agerat och ska vara samstämmig med resten av informationen i värdepappersföretagets transaktionsrapport(er).

¹⁶ Såvida det inte uppfyller de krav som ställs på en vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 – se avsnitt 5.26.

5.2.1 Handel för egen räkning (DEAL)

När ett värdepappersföretag handlar för egen räkning ska det rapporteras antingen som köpare eller säljare i transaktionsrapporten. Motsvarande säljare eller köpare är den motpart eller kund eller handelsplats¹⁷ som värdepappersföretaget handlar med. Värdepappersföretaget kan handla enbart med eget ägarintresse eller handla för egen räkning med avsikten att fylla order som det har erhållit från en kund. I sistnämnda fall kan datum och tidpunkt för handel för kundsidan av rapporten vara samma som för marknadssidan av rapporten, eller kan vara senare och priset i rapporterna avseende marknadssidan och kundsidan kan vara samma eller olika.

5.2.1.1 Handel för egen räkning

Exempel 1

Värdepappersföretag X handlar för egen räkning och förvärvar finansiella instrument på handelsplats M.

I rapporten från värdepappersföretag X ska följande anges:

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
29	Handelskapacitet	"DEAL"	

¹⁷ Såsom föreskrivs i block 5.

5.2.1.2 Handel för en kund

Exempel 2

Värdepappersföretag X erhåller en order från en kund, kund A, att förvärva ett finansiellt instrument. Värdepappersföretag X handlar för egen räkning genom att förvärva instrumentet på handelsplats M och sälja instrumenten till kund A.

Såsom påpekats ovan kan priset i de olika rapporterna från värdepappersföretag X variera, dvs. värdepappersföretag X kan köpa från en handelsplats/motpart för 0,352 GBP och sälja till kund A för 0,370 GBP, vilket innebär att värdepappersföretag X ska rapportera på följande sätt:

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
33	Pris	"0,352"	"0,370"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF" ¹⁸

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>

¹⁸ Se avsnitt 5.4 för användningen av "XOFF" i fältet avseende handelsplats.

<pre> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.37</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>
---	--

Exempel 3

Värdepappersföretag X erhåller en order från en kund, kund A, att förvärva finansiella instrument och fyller ordern från sina egna böcker.

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
29	Handelskapacitet	"DEAL"	
36	Handelsplats	XOFF	

5.2.2 Handel med matchad principal handelskapacitet (MTCH)

I artikel 4.1.38 i MiFID II definieras matchad principalhandel som "en transaktion där en mellanhand själv träder emellan transaktionens köpare och säljare på ett sådant sätt att den under transaktionens utförande aldrig exponeras för marknadsrisk [...]". Således ska det framgå av transaktionsrapporten att det utförande värdepappersföretagets position inte ändras till följd av transaktionen.

Om det bara finns en kund ska endast en transaktionsrapport lämnas in som både innehåller information om marknadssidan och om kundsidan. Kunden/kunderna ska anges i fältet för köpare/säljare medan handelsplatsen eller motparten ska anges i fältet för säljaren/köparen. Om mer än en kund är inblandad kan det ackumulerade kundkontot (avsnitt 5.23 om grupporder) användas för att koppla marknadssidan till tilldelningen till varje kund såsom visas i exempel 61, och rapporterna avseende kundsidan ska omfatta alla tillämpliga fält.

Exempel 4

Om transaktionen i det första exemplet i 5.2.1 ägde rum på handelsplats M klockan 09:30:42.124356 den 9 juni 2018 till ett pris på 0,352 GBP, och värdepappersföretag X handlade med matchad principalkapacitet, ska följande anges i rapporten från värdepappersföretag X:

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T09:30:42.124Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-09T09:30:42.124Z"	
29	Handelskapacitet	"MTCH"	
33	Pris	"0,352"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	

			<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.2.3 Handel enligt "annan kapacitet" (AOTC)

Alla andra aktiviteter som inte omfattas av definitionerna för handel för egen räkning eller matchad principalhandel ska rapporteras med handelskapaciteten "annan kapacitet", vilken innefattar när verksamheten äger rum i egenskap av agent.

Exempel 5

Värdepappersföretag X som handlar för kund A:s räkning förvärvar finansiella instrument på handelsplats M. Transaktionen utfördes klockan 09:30:42.124356 den 9 juni 2018 till ett pris på 0,352 GBP.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </pre>
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-09T09:30:42.124Z"	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </pre>
29	Handelskapacitet	"AOTC"	<pre> <Tx> <TradDt> 2018-06-09T09:30:42.124Z </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </pre>
33	Pris	"0,352"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	

			<pre> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Denna transaktionsrapport är identisk med den transaktionsrapport som skulle ha upprättats ifall värdepappersföretag X handlade med matchad principalhandelskapacitet, förutom fältet avseende handelskapacitet.

5.2.4 Begränsningar av handelskapaciteten

Värdepappersföretag som handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalhandel handlar själva direkt och kan inte "vidarebefordra order" enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, eftersom alla order som de lämnar till ett annat företag eller värdepappersföretag är deras egna order, snarare än att vara en vidarebefordran av en order som erhållits från en kund, eller följa av ett beslut att förvärva eller avyttra ett finansiellt instrument för en kund i enlighet med en diskretionär fullmakt. Om värdepappersföretag vidarebefordrar order som inte uppfyller villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 förväntar Esma således endast att de rapporterar enligt "annan kapacitet".

Såsom anges i avsnitt 5.28 ska en DEA-operatör rapportera som om denne handlade med AOTC- eller MTCH-kapacitet.

5.3 Kedjor och vidarebefordran

5.3.1 Allmänt

En rapporteringskedja föreligger när ett företag eller ett värdepappersföretag inte självt slutför en transaktion utan skickar ordern till ett annat företag eller värdepappersföretag för att slutföras. Detta omfattar situationer där

- (i) ett företag eller värdepappersföretag skickar sin egen order till ett företag för slutförande,
- (ii) ett företag eller värdepappersföretag erhåller en order från sin kund och skickar den till ett annat företag eller värdepappersföretag för slutförande, eller
- (iii) fattar ett beslut att förvärva eller avyttra ett finansiellt instrument i enlighet med en diskretionär fullmakt som det erhållit från sin kund och placerar det hos ett annat företag eller värdepappersföretag.

Såvida det inte är frågan om en vidarebefordran i den mening som avses i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 gör det faktum att ett värdepappersföretag är del i en kedja inte någon skillnad vad gäller dess rapporteringsskyldighet, förutom att transaktionsrapporterna från de värdepappersföretag i kedjan som vidarebefordrar en order utan att iaktta artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska återspegla kvantitet, pris och datum och tidpunkt för utförandet som bekräftats av det företag eller värdepappersföretag som har slutfört dess order (se 5.27.1.2). Värdepappersföretaget ska endast rapportera sin "del" i kedjan och behöver därför inte se framåt eller bakåt i kedjan bortom dess direkta motpart och kund. Rapporteringen från ett värdepappersföretag i en kedja där nämnda företag utför transaktionen enligt ii) och iii) i ovanstående stycke när de villkor som fastställs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 inte är uppfyllda är densamma¹⁹ som när ett värdepappersföretag handlar direkt med en handelsplats eller en motpart på marknaden eller kund för att slutföra en transaktion (se underavsnitt 5.26.2 i del III i riktlinjerna).

Villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är inte tillämpliga på företag. Om ett värdepappersföretag erhåller en order från ett företag ska det således rapportera köparen/säljaren som företaget som skickade ordern, i stället för företagets bakomliggande kund. Detta är tillämpligt avseende order som har erhållits från ett företag som förvaltar värdepapper och som inte är ett värdepappersföretag. Det mottagande värdepappersföretaget ska identifiera kunden (köparen/säljaren) som det förvaltande företaget snarare än de bakomliggande fonderna/kunderna.

5.3.2 Kedja där ett företag handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet

Värdepappersföretag som handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet handlar själva direkt och anses inte vara vidarebefordrande värdepappersföretag, under förutsättning att alla order som de skickar till ett företag eller värdepappersföretag är deras egna, i stället för att vara en vidarebefordran av en order som erhållits från en kund eller som kan hänföras till ett beslut att förvärva eller avyttra ett finansiellt instrument för en kund i enlighet med en diskretionär fullmakt. För exempel hänvisas till underavsnitt **Error! Reference source not found.** i del III i riktlinjerna.

5.3.3 Vidarebefordran

Värdepappersföretag som utför verksamheten enligt ii) och iii) i punkt 5.3.1 ovan har att välja mellan att antingen följa kraven på vidarebefordran som fastställs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 eller att rapportera transaktionen.

Enligt artikel 3.2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska "[e]tt värdepappersföretag [...] inte anses ha genomfört en transaktion om det har vidarebefordrat en order i enlighet med artikel 4". Det mottagande företaget ska fylla i den särskilda information som anges i tabellen över fält i sin egen transaktionsrapport. Det mottagande företaget ska göra detta som en del av sin vanliga rapportering och behöver inte bli en ARM.

I enlighet med kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (fälten 7, 16 och 25) ska ett värdepappersföretag som utför verksamheten enligt ii) och iii) i 5.3.1 och inte uppfyller villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i samma standard rapportera transaktionen och fylla i "true" i fältet

¹⁹ Fältet avseende uppgift om vidarebefordran av order ska dock fyllas i på ett annat sätt.

avseende uppgift om vidarebefordran av order. Det mottagande värdepappersföretaget ska rapportera det vidarebefordrande värdepappersföretaget som sin köpare/säljare. När en kund till ett vidarebefordrande värdepappersföretag är rapporteringsskyldig ska kunden rapportera det vidarebefordrande värdepappersföretaget som sin köpare/säljare i stället för det mottagande värdepappersföretaget (som visas under 5.26.3.3).

Om ett värdepappersföretag handlar på en handelsplats som inte är en OTF-plattform (organiserad handelsplattform), på grundval av matchad principalkapacitet eller för egen räkning, kan värdepappersföretaget inte anses vidarebefordra, eftersom det inte vidarebefordrar en order till ett värdepappersföretag utan självt utför ordern direkt på handelsplatsen, och således ska "false" anges i fält 25.

Vad gäller krav på vidarebefordran gäller principen "allt eller inget", vilket innebär att om ett företag som skickar en order inte vidarebefordrar all information som krävs för att uppfylla kraven enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska det mottagande värdepappersföretaget rapportera som om det inte vore fråga om en vidarebefordran.

Om det föreligger en vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 påverkar detta inte tillämpningen av artikel 14 i RTS 22, vilket innebär att ett mottagande värdepappersföretag ska skicka eventuella rapporter till den behöriga myndigheten i sitt hemland.

Det föreligger inte någon vidarebefordran mellan filialer från samma värdepappersföretag, eftersom de inte utgör separata juridiska personer. Om vidarebefordran däremot äger rum mellan olika juridiska personer inom en koncern är samma rapporteringskrav tillämpliga på dessa enheter som om de hade varit icke närstående värdepappersföretag eller företag.

Syftet med fält 25 (uppgift om vidarebefordran av order) är att indikera att en vidarebefordran har gjorts inom kedjan till ett annat värdepappersföretag utan att villkoren i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är uppfyllda. Ett vidarebefordrande värdepappersföretag som agerar i egenskap av agent ska rapportera "true" i fält 25 oberoende av huruvida värdepappersföretaget försökte och misslyckades att vidarebefordra eller helt enkelt valde att inte vidarebefordra.

Mot bakgrund av ovanstående ska följande situationer beaktas när fält 25 fylls i:

1. Om ett värdepappersföretag vidarebefordrar och uppfyller alla krav som föreskrivs i artikel 4 ska det inte rapportera.
2. Om ett värdepappersföretag på en handelsplats som inte är en organiserad handelsplattform handlar direkt på grundval av matchad principalkapacitet eller för egen räkning ska "false" anges i fält 25 (uppgift om vidarebefordran av order).
3. Om ett värdepappersföretag handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet (fält 29 = "DEAL"/"MTCH") ska "false" anges i fält 25 (uppgift om vidarebefordran av order).
4. Om ett värdepappersföretag vidarebefordrar order från sina kunder eller placerar order på diskretionär grund för sina kunder och inte uppfyller villkoren i artikel 4 ska det framgå av dess rapport att det handlar enligt "annan kapacitet" (fält 29 = "AOTC") och fält 25 ska fyllas i med "true".
5. I andra fall där värdepappersföretaget handlar enligt "annan kapacitet" (fält 29 = "AOTC") ska "false" anges i fält 25.

5.4 Utförande av en transaktion på en handelsplats

Med avseende på fält 36 ska en transaktion endast anses genomföras på en handelsplats om

- i) handelsplatsen sammanför köp- och säljintressen från två parter antingen på diskretionär eller icke-diskretionär grund

eller

- ii) handelsplatsen inte sammanför köp- och säljintressen från två parter antingen på diskretionär eller icke-diskretionär grund, men transaktionen ändå omfattas av handelsplatsens regler och utförs i enlighet med dessa regler.

Om ett värdepappersföretag inte är den enhet som är direkt vänd mot marknaden anses detta värdepappersföretag inte vara utförande på handelsplatsen vad gäller transaktionsrapporteringen.

5.4.1 Identifieringskod för handelsplatstransaktioner (fält 3)

Enligt artikel 12 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 ska "[o]peratörer av handelsplatser [...] upprätthålla en individuell identifieringskod" för varje transaktion som följer av ett fullständigt eller partiellt genomförande av en order som har hanterats i dess matchningssystem. Till denna identifieringskod för handelsplatstransaktioner (TVTIC) hänvisas i fält 3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, enligt vilket värdepappersföretag ska fylla i den relevanta TVTIC som genererats av handelsplatsens operatör "för marknadssidan av en transaktion som utförs på en handelsplats".

Operatörer av handelsplatser kan även generera denna identifieringskod för transaktioner som omfattas av punkt ii) i definitionen av transaktioner som "utförs på en handelsplats" enligt avsnittet ovan, och om en sådan kod genereras under sådana omständigheter och ett värdepappersföretag erhåller koden från handelsplatsen får värdepappersföretaget välja att fylla i den relevanta kod som genererats av operatören av denna handelsplats i fält 3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

5.4.2 Rapportering av fältet avseende handelsplats för kedjor (fält 36)

Om transaktionsrapporten avser en transaktion som genomförts på en handelsplats såsom klargjorts ovan i stycke 5.4, med en SI eller på en organiserad handelsplattform utanför unionen, ska MIC-koden från denna handelsplats, handelsplattform eller SI anges i fält 36 i rapporten avseende marknadssidan. Alla andra rapporter i kedjan ska fyllas i med "XOFF".

5.5 Identifieringskoder för parterna

Enheter som är berättigade till en LEI ska identifieras med en sådan enligt artikel 26.6 i MiFIR och artikel 5 i och bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Dessa enheter omfattar särskilt partnerskap, bolag, föreningar och enskilda som agerar i egenskap av näringsidkare²⁰. En filial ska

²⁰ Enskilda personer som handlar som näringsidkare anses utgöra värdepappersföretag på vissa villkor som definieras i artikel 4.1.1 i MiFID. Uttalandet från LEI ROC-kommittén (Regulatory Oversight Committee) om berättigande för enskilda personer som agerar i egenskap av näringsidkare ska beaktas för ytterligare detaljer (http://www.leiroc.org/publications/gls/loi_20150930-1.pdf).

identifieras med den LEI som dess huvudkontor har, även om den i vissa fall skulle kunna anses ha rätt att erhålla en LEI²¹.

Vid genomförandet ska värdepappersföretag se till att deras LEI-kod förnyas i enlighet med de villkor som ställs av någon av de lokala registerförare (Local Operating Units, LOU) som ingår i det globala LEI-systemet enligt artikel 5.2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Det föreligger inte någon skyldighet enligt artikel 13.3 att säkerställa att en LEI har förnyats för en kund eller en motpart.

I artikel 6 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 anges att en fysisk person ska identifieras genom den nationella identifieringskod som anges i bilaga II till standarden. Observera att det föreskrivs i artikel 26.1 i MiFIR att värdepappersföretag ska lämna riktiga och korrekta uppgifter om transaktioner. Eftersom identifieringskoder för fysiska personer tillhör de uppgifter som hör samman med en viss transaktion är kravet på att lämna riktiga och korrekta uppgifter även tillämpligt på identifieringskoder för fysiska personer. För att säkerställa att detta krav är uppfyllt kan bland annat värdepappersföretag kräva att den fysiska personen visar att identifieringskoden är riktig och giltig genom att tillhandahålla officiella dokument. Om kunden inte tillhandahåller någon identifieringskod kan värdepappersföretaget inte uppfylla detta krav vad gäller transaktionsrapporteringen.

I artikel 6.3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 behandlas inte situationer i vilka en fysisk person är medborgare i mer än ett land utanför EES. Sådana situationer måste lösas genom samma sorteringsförfarande som tillämpas på personer som är medborgare i mer än ett EES-land.

5.5.1 Förfarande för att generera CONCAT

CONCAT-koden ska inte användas som en standard med avseende på identifieringskoden och ska aldrig användas för de länder som enligt tabellen i bilaga II inte har valt CONCAT-koden som identifieringskod i någon av de tre prioriteringsmöjligheterna.

En CONCAT ska bildas genom följande metod i fyra steg:

1. Erhållande av för- och efternamn

För att minimera risken för skillnader i stavning eller användning av förkortningar ska värdepappersföretaget säkerställa att personens fullständiga namn är riktigt stavat. Det är inte tillåtet att använda någon form av förkortningar.

2. Avlägsnande av titlar

Alla prefix till namnen som anger titlar, ställning, yrke eller akademiska kvalifikationer ska tas bort. Detta omfattar, men är inte begränsat till, följande förteckning, där det inte görs skillnad mellan gemener och versaler:

atty, coach, dame, dr, fr, gov, honorable, madam(e), maid, master, miss, monsieur, mr, mrs, ms, mx, ofc, ph.d, pres, prof, rev, sir

²¹ Enligt LEI ROC-uttalandet från den 11 juli 2016 kan vissa filialer anses berättigade till en LEI i enlighet med de villkor som anges i uttalandet. För ytterligare detaljer, se LEI ROC-uttalandet (http://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf).

3. Avlägsnande av prefix

am, auf, auf dem, aus der, d, da, de, de l", del, de la, de le, di, do, dos, du, im, la, le, mac, mc, mhac, mhíc, mhic giolla, mic, ni, ní, níc, o, ó, ua, ui, uí, van, van de, van den, van der, vom, von, von dem, von den, von der

Prefix till efternamn som inte anges ovan, eller prefix som sitter ihop med namnet, t.ex. McDonald, MacChrystal, O'Brian, O'Neal, ska inte tas bort. Observera emellertid att apostroferna kommer att avlägsnas i nästa steg. I ovanstående förteckning görs inte någon skillnad mellan gemener och versaler.

4. Translitterering av apostrofer, accenter, bindestreck, mellanslag och liknande

Följande translittereringstabell ska tillämpas, tecken för tecken, på för- och efternamn. Generellt beskrivet berörs inte de engelska bokstäverna A–Z eller a–z av translittereringen och alla diakritiska tecken, apostrofer, bindestreck, punkter och mellanslag tas bort.

Translittereringstabell

Följande tabell visar hur varje enskilt ingående tecken motsvaras av ett enskilt utgående tecken. Denna tabell ska tillämpas på för- och efternamn efter erhållande av de fem första tecknen, såsom specificeras i artikel 6.4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

För namn som skrivs med kyrilliska, grekiska eller med andra icke-latinska alfabet, och där det inte finns någon latinsk form, ska en translittererad engelsk version av namnet tillämpas med användning av den metod som är vedertagen enligt detta alfabet.

Utgående	Ingående	Ingående Unicode-kodpunkter
A	Ä ä À à Á á Â â Ã ã Ä ä Ă ă Ą ą Ħ ħ Æ æ	U+00C4 U+00E4 U+00C0 U+00E0 U+00C1 U+00E1 U+00C2 U+00E2 U+00C3 U+00E3 U+00C5 U+00E5 U+01CD U+01CE U+0104 U+0105 U+0102 U+0103 U+00C6 U+00E6
C	Ç ç Ć ć Ĉ ĉ Ċ ċ	U+00C7 U+00E7 U+0106 U+0107 U+0108 U+0109 U+010C U+010D
D	Đ đ Ð ɖ ɔ	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0
E	Ê ê É é Ê ê Ë ë Ě ě Ė ę	U+00C8 U+00E8 U+00C9 U+00E9 U+00CA U+00EA U+00CB U+00EB U+011A U+011B U+0118 U+0119
G	Ĝ ĝ Ğ ğ Ğ ğ	U+011C U+011D U+0122 U+0123 U+011E U+011F
H	Ĥ ĥ	U+0124 U+0125
I	İ i Í í Î î Ï ï	U+00CC U+00EC U+00CD U+00ED U+00CE U+00EE U+00CF U+00EF U+0131
J	Ĵ ĵ	U+0134 U+0135
K	Ķ ķ	U+0136 U+0137
L	Ĺ ĺ Ľ ľ Ł ł Ľ ľ	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ñ ñ Ó ó Œ œ	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ö ö Õ õ Ó ó Œ œ	U+00D6 U+00F6 U+00D2 U+00F2 U+00D3 U+00F3 U+00D4 U+00F4 U+00D5 U+00F5 U+0150 U+0151 U+00D8 U+00F8 U+0152 U+0153
R	Ř ř Ŕ ŕ	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159

S	ß Š š Š š Š š Š š Š š	U+1E9E U+00DF U+015A U+015B U+015C U+015D U+015E U+015F U+0160 U+0161 U+0218 U+0219
T	Ť ť Ť ť Ț ț Ț ț	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ü ü Û û Ú ú Ů ů Ů ů ŭ Ȯ ȯ Ȱ ȱ	U+00DC U+00FC U+00D9 U+00F9 U+00DA U+00FA U+00DB U+00FB U+0170 U+0171 U+0168 U+0169 U+0172 U+0173 U+016E U+016F
W	Ŵ ŵ	U+0174 U+0175
Y	Ý ý Ÿ ŷ Ŷ ŷ	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Ž ž Ž ž Ž ž	U+0179 U+017A U+017D U+017E U+017B U+017C
{DELETE}	Förutom a–z och A–Z ska alla andra tecken som inte anges ovan tas bort.	

Valda exempel

Notera att dessa exempel endast är tillämpliga om den nationella identifieringskoden är CONCAT. För de flesta länder finns det identifieringskoder med högre prioritet (artikel 6.2) i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Förnamn	Efternamn/ förnamn	Landskod + CONCAT	Kommentar
John	O'Brian	IE19800113JOHN#OBRIA	Utfyllnad av "John" till 5 bokstäver. O' sitter ihop med namnet, ej konverterat. Apostrof borttaget.
Ludwig	Van der Rohe	HU19810214LUDWIROHE#	Prefixet "Van der" borttaget.
Victor	Vandenberg	US19730322VICTOVANDE	"Van" sitter ihop och anses inte utgöra ett prefix.
Eli	Ødegård	NO19760315ELI##ODEGA	Utfyllnad av "Eli" till 5 bokstäver. Konverterat Ø till O, och å till A.
Willeke	de Bruijn	LU19660416WILLEBRUIJ	Prefixet "De" borttaget.
Jon Ian	Dewitt	US19650417JON##DEWIT	Utfyllnad av "Jon" till 5 bokstäver. Ignorerat "Ian", endast det första namnet ska användas. "De"-delen av "Dewitt" är inte ett prefix.
Amy-Ally	Garção de Magalhães	PT19900517AMYALGARCA	Bindestreck från förnamnet borttaget. Bokstäver har translittererats.
Giovani	dos Santos	FR19900618GIOVASANTO	Prefix borttaget.
Günter	Voß	DE19800715GUNTEVOS##	Konverterat ü till U, och ß till S.

5.5.2 Förnamn och efternamn

För att alla fält där det krävs "förnamn" eller "efternamn" i tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska fyllas i ska enbart steg 1 (erhållande av för- och efternamn) och steg 2 (avlägsnande av titlar) tillämpas i den metod som beskrivs i avsnitt 5.5.1 "Förfarande för att generera CONCAT". Någon translitterering ska således inte göras och prefix ska inte tas bort. Alla tecken som

används i ett EU-land, inbegripet diakritiska varianter, får användas. Alla bokstäver i prefix, för- och efternamn ska anges med versaler.

5.6 Innebörden av transaktion

5.6.1 Förvärv och avyttringar

Såsom förklaras i inledningen till block 1 har behöriga myndigheter, i syfte att förhindra marknadsmissbruk, intresse av ändringar i äganderätten till finansiella instrument. Rörelser som inte medför något ägarbyte ska inte rapporteras. Ett exempel är en överföring från ett kundkonto som förvaltas i enlighet med en diskretionär fullmakt och ett som förvaltas enbart för att genomföra order.

Undantag från detta är det samtidiga förvärv och avyttring som särskilt hänvisas till i artikel 2.4 i RTS 22 där det föreligger offentliggörande efter handel. Detta är enbart tillämpligt i en situation där ett värdepappersföretag möter sin egen order i orderboken på en handelsplats. Ett exempel på rapportering i denna situation tillhandahålls i avsnitt 5.14.3.

5.6.2 Undantag från rapportering

5.6.2.1 Undantag enligt artikel 2.5 a

Vid tillämpning av artikel 2.5 a i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska följande exempel beaktas:

Exempel 6

Två värdepappersföretag ingår ett avtal om återköp (repo) avseende statsobligationer. Ett av värdepappersföretagen rapporterar transaktionen enligt förordningen om värdepappersfinansiering (SFTR).

Inget av värdepappersföretagen är skyldigt att rapportera transaktionen, eftersom den har rapporterats enligt SFTR.

Exempel 7

Ett värdepappersföretag som handlar för ett företag för kollektiva investeringar i enlighet med en diskretionär fullmakt ingår ett avtal om återköp (repo) avseende statsobligationer. Fonden antas vara rapporteringsskyldig enligt SFTR, men inte värdepappersföretaget.

Värdepappersföretaget har inte någon skyldighet att rapportera transaktionen enligt MiFIR, eftersom den har rapporterats enligt SFTR.

5.6.2.2 Undantag enligt artikel 2.5 b

Vad gäller instruktioner om leverans/betalning vid överföringar omfattas motparter för clearing och/eller avveckling (inbegripet värdepapperscentraler) inte av rapporteringskraven enligt artikel 2.5 b i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, utan endast det värdepappersföretag som utför transaktionen är rapporteringsskyldigt.

Detsamma gäller ett OTC-avtal som clearats, där en novation till olika clearade avtal inte ska rapporteras.

5.6.2.3 Undantag enligt artikel 2.5 d

Exempel 8

En förvaltare/ett ombud beslutar att flytta finansiella instrument från en depåbank till en annan depåbank.

Det föreligger inte någon skyldighet att transaktionsrapportera för flytten av de finansiella instrumenten, eftersom denna åtgärd endast härstammar från förvaltningsverksamheten.

Exempel 9

En kund överför finansiella instrument till en förvaltare/ett ombud för att denne ska förvalta dem på sitt förvaltnings-/ombudskonto.

Det föreligger inte någon skyldighet att transaktionsrapportera för denna överföring, eftersom den endast har samband med förvaltningsverksamheten.

5.6.2.4 Undantag enligt artikel 2.5 e

Enligt artikel 2.5 e i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 undantas från transaktioner överlåtelser eller novationer av ett derivatavtal där en av parterna i avtalet ersätts av en tredje part. Därför ska avtal som avslutas i förtid på grund av clearing och efterföljande novation av samma avtal som medför att en ursprunglig avtalspart ersätts inte rapporteras.

5.6.2.5 Undantag enligt artikel 2.5 g

Enligt artikel 2.5 g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 undantas från en transaktion *"skapande eller inlösen av ett företag för kollektiva investeringar av förvaltaren av det företaget"*.

För börshandlade fonder ska detta förfarande för att skapa eller lösa in en enhet från ett företag för kollektiva investeringar mellan en auktoriserad deltagare och förvaltaren från företaget för kollektiva investeringar inte vara föremål för transaktionsrapportering. Detta förfarande omfattar situationen där den auktoriserade deltagaren tillhandahåller det underliggande finansiella instrumentet som företaget för kollektiva investeringar består av till förvaltaren från företaget för kollektiva investeringar i utbyte mot erhållandet av en enhet från företaget för kollektiva investeringar (skapande). Detta undantag är även tillämpligt vid det omvända förfarandet (inlösen). Denna verksamhet är undantagen då risken för marknadsmissbruk är minimal, i och med att detta är en administrativ process där likvärdiga ekonomiska prestationer utväxlas.

Ett värdepappersföretag köper enheter i ett företag för kollektiva investeringar, vilket kan men inte behöver vara en börshandlad fond, direkt från förvaltaren av företaget för kollektiva investeringar till ett pris som fastställs i enlighet med prospekten från företaget för kollektiva investeringar. Transaktionen består av ett skapande av enheter och ska inte rapporteras av värdepappersföretaget. Detsamma gäller om transaktionen var ett köp av värdepappersföretaget till samma villkor. Detta är en inlösen av enheterna och ska inte rapporteras.

Detta undantag är endast tillämpligt på det förfarande för skapande/inlösen som äger rum med förvaltaren av företaget för kollektiva investeringar. När denna enhet väl har skapats ska alla förvärv och avyttringar av enheten på den sekundära marknaden (inbegripet utanför marknaden) rapporteras, oberoende av huruvida priset för förvärvet eller avyttringen fastställts till nettotillgångsvärdet (NAV).

Exempel 10

Värdepappersföretag X (auktoriserad deltagare) önskar förvärva nya enheter i ett företag för kollektiva investeringar från förvaltaren av företaget för kollektiva investeringar för att möta efterfrågan på andelar från sina kunder.

Om värdepappersföretag X behöver förvärva det underliggande finansiella instrument som företaget för kollektiva investeringar består av på den sekundära marknaden för att utföra skapandet ska dessa förvärv av de underliggande finansiella instrumenten transaktionsrapporteras, om det antas att de underliggande finansiella instrumenten ska rapporteras enligt artikel 26.2.

Värdepappersföretag X gör sedan ett utbyte i natura med förvaltaren av företaget för kollektiva investeringar av de underliggande finansiella instrumenten. Detta behöver varken transaktionsrapporteras av värdepappersföretag X eller förvaltaren av företaget för kollektiva investeringar, eftersom det är del av skapandeprocessen.

5.6.2.6 Undantag enligt artikel 2.5 h

Utövandet av en rättighet, kopplad till ett finansiellt instrument såsom en option, täckt köpoption, ett konvertibelt eller utbytbar skuldebrev, tilldelad rättighet eller teckningsrätt från ägaren till det finansiella instrumentet medför inte en rapporteringsskyldighet för det värdepappersföretag som utnyttjar optionen eller det värdepappersföretag mot vilket rättigheten utövas²². Inte heller när utövandet medför en leverans av ett annat finansiellt instrument ska detta rapporteras av det värdepappersföretag som utnyttjar optionen eller det värdepappersföretag mot vilket den utövas/tillskrivs.

Exempel 11

Värdepappersföretag X utövar rättigheter kopplade till ett finansiellt instrument. Det föreligger inte någon rapporteringsskyldighet vad gäller utövandet av det finansiella instrumentet.

Om värdepappersföretag X utövar *rättigheter kopplade till* ett finansiellt instrument och erhåller det underliggande finansiella instrumentet i stället för kontanter ska det förvärv detta medför av det underliggande finansiella instrumentet inte heller rapporteras.

Om värdepappersföretag X utövar *rättigheter kopplade till* ett finansiellt instrument och ska välja mellan att erhålla kontanter eller det underliggande finansiella instrumentet behöver detta inte rapporteras.

Exempel 12

²² Utövas mot innefattar situationer som rör börshandlande fonder där värdepappersföretaget eller dess kund ska leverera (det underliggande) som ett resultat av tilldelningsprocessen och den underliggande transaktionen utförs av den centrala motparten och/eller den centrala motpartens clearingmedlemmar, för att följa instruktioner från en annan part.

Innehavaren av ett finansiellt instrument eller konvertibelt skuldebrev utövar rättigheter för ett finansiellt instrument eller konvertibelt skuldebrev. Som ett resultat av detta utövande eller denna omvandling förvärvar eller avyttrar värdepappersföretag X (den part mot vilken instrumentet utövas) underliggande finansiella instrument (t.ex. på en handelsplats) så att det kan leverera dessa instrument till innehavaren.

En transaktionsrapport ska inges med avseende på förvärvet/avyttringen av de underliggande finansiella instrumenten (t.ex. förvärvet på handelsplatsen). Det finns emellertid inte någon skyldighet att rapportera transaktionen med avseende på överföringen av dessa underliggande finansiella instrument till innehavaren, eller med avseende på utövandet/omvandlingen av det finansiella instrumentet.

5.6.2.7 Undantag enligt artikel 2.5 i

Det finns ett specifikt undantag från undantaget i artikel 2.5 i, i vilket föreskrivs att om verksamheten i artikel 2.5 i äger rum inom ramen för offentliga anbud, sekundära offentliga anbud eller placeringar eller utfärdande av skuldebrev ska den rapporteras.

Undantaget enligt artikel 2.5 i omfattar avslutande av finansiella instrument när de löper ut på förfallodagen.

När förvärv eller avyttringar sker i samband med fusioner, uppköp, insolvensförfaranden enligt rådets förordning (EG) nr 1346/2000²³, aktiesplit eller omvänd aktiesplit behöver dessa inte rapporteras. I sådana situationer fastställs villkoren normalt sett i förväg vid bolagsstämman, tillkännages genom offentliggörande av relevant information och investerare omfattas av denna överenskommelse utan att de fattar ytterligare beslut.

Utfärdande av utdelning i form av aktier ska inte rapporteras enligt undantaget ovan, eftersom detta omfattar skapandet av finansiella instrument som ett resultat av förutbestämda avtalsvillkor där investeraren inte fattar något investeringsbeslut vid den tidpunkt som instrumentet skapas.

Automatiska teoretiska ökningar eller minskningar som härstammar från avskrivningsplaner ska inte heller rapporteras, eftersom villkoren redan fastställdes vid tidpunkten för det ursprungliga avtalet utan att något beslut fattades vid tidpunkten för den teoretiska minskningen/ökningen.

Emellertid ska händelser rapporteras när investeraren fattar ett beslut vid den tidpunkten det finansiella instrumentet skapas, löper ut eller återköps. Detta omfattar när kunden väljer att erhålla kontanter eller instrument vid ett bud om övertagande eller när den utfärdande parten får välja att leverera i kontanter eller i finansiella instrument.

Exempel 13

Värdepappersföretag X innehar obligationer i ett företag med en löptid på fem år. Enligt utfärdandevillkoren har bolaget rätt att lösa in en del av de finansiella instrumenten innan de löper ut. Efter tre år löser bolaget in en del av det nominella värdet från de utfärdade obligationerna.

²³ RÅDETS FÖRORDNING (EG) nr 1346/2000 av den 29 maj 2000 om insolvensförfaranden.

Det föreligger inte någon skyldighet att rapportera transaktioner med avseende på inlösen av obligationerna. Detta beror på att det är ett resultat av förutbestämda avtalsvillkor som ligger utanför investerarens (värdepappersföretag X) kontroll.

5.6.2.8 Undantag enligt artikel 2.5 l

Enligt artikel 2.5 l i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 undantas "ett förvärv enligt en plan för återinvestering av utdelningar" från en transaktion.

Ett program eller en plan för återinvestering av utdelningar (DRIP) är en option för aktieinvestering där investeraren i stället för att erhålla utdelningen direkt i kontanter i förväg väljer att återinvestera sin utdelning direkt i de underliggande aktierna.

Mot bakgrund av ovannämnda beskrivning finns det inte någon skyldighet att rapportera transaktioner med avseende på förvärvet av aktierna.

5.6.2.9 Undantag enligt artikel 2.5 m

Detta undantag är inte tillämpligt på rapportering av blockorder (ackumulerade förvärv och avyttringar på marknaden för kunders räkning inom ramen för investeringsplaner för sparande och återkallelse), eftersom det, även om förvärven och avyttringarna följer en plan, fattas vissa beslut vid tidpunkten för förvärvet eller avyttringen och således är inte alla villkor som föreskrivs för ett undantag uppfyllda.

Exempel 14

Ett bolag erbjuder sina anställda möjlighet att förvärva aktier i enlighet med ett program där antalet aktier som kan förvärfas motsvarar 3 % av den anställdes årslön, vilka kan förvärfas till ett rabatterat marknadspris sista dagen i varje kvartal om den anställda har meddelat förvärvsbeslutet senast i slutet av föregående månad.

Bolaget anlitar värdepappersföretag X för att tilldela aktier till de anställda och ta emot betalning för bolagets räkning, i egenskap av dess ombud.

En anställd beslutar att köpa aktier i mars genom programmet för 350 euro (marknadspris). Den anställda deltar även i september med 375 euro och i december med 400 euro.

Värdepappersföretag X har inte någon skyldighet att rapportera transaktionerna i mars, september eller december, eftersom inget av förvärven överstiger 500 euro per månad och det inte är fråga om en enskild transaktion inom programmet även om de totalt sett överstiger 1 000 euro.

5.6.2.10 Undantag enligt artikel 2.5 n

Exempel 15

Ett bolag lämnar ett anbud om att köpa tillbaka sina obligationer från en investerare till överkurs. Villkoren för anbudet hade redan offentliggjorts genom tillhandahållande av information eller prospekt. Bolaget anlitar värdepappersföretag X som förvaltare.

Det finns inte någon skyldighet att rapportera transaktioner för värdepappersföretag X eller investerarna, eftersom villkoren har offentliggjorts i förväg och investerarna enbart kunde välja att acceptera eller förkasta anbudet.

5.7 Rapporteringsmekanismer

En beskrivning av hur de behöriga myndigheterna behandlar rapporter som erhålls från inlämnande enheter återfinns i bilaga I till dessa riktlinjer.

5.7.1 Fält som inte är tillämpliga och ifyllande av fält för instrumentreferensuppgifter

När det föreskrivs i tabellen över fält att ett fält inte är tillämpligt under de omständigheter som fastställs i beskrivningen av fältet eller i valideringstabellen på https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf ska detta fält inte fyllas i och transaktionsrapporten ska avvisas om den inte uppfyller de krav som specificeras i tabellen på Esmas webbplats. Om ett företag till exempel anger i rapporten att utförandet ägde rum genom algoritm ska fält 60 (land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet) inte fyllas i.

Ifyllandet av information om referensuppgifter skiljer sig åt något. I tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 anges att fälten 42–56 inte gäller när transaktionerna genomförs på en handelsplats eller med ett värdepappersföretag som agerar som systematisk internhandlare, eller när fält 41 fylls i med en ISIN-kod som finns i Esmas förteckning över referensdatafält. Om ett av dessa villkor är uppfyllt behöver värdepappersföretag inte fylla i dessa fält. Esma anser även att transaktioner som genomförs under en handelsdag i ett instrument för vilket värdepappersföretaget självt har genomfört åtminstone en transaktion denna handelsdag på en handelsplats eller med ett värdepappersföretag som handlar som en systematisk internhandlare, uppfyller de villkor som fastställs i tabell 2 varför fälten för instrumentets referensuppgifter således är överflödiga vid en sådan transaktion.

Exempel 16

Värdepappersföretag X köper instrument Y på en handelsplats och säljer nämnda instrument OTC senare samma dag till ett annat värdepappersföretag eller företag. Instrument Y finns inte i Esmas förteckning över referensdatafält²⁴. Förvärvet ägde rum på en handelsplats och således krävs det inte att fälten för instrumentets referensuppgifter fylls i för transaktionsrapporten för köpet. Säljtransaktionen uppfyller inte direkt villkoren eftersom den inte handlas på en handelsplats. Men eftersom inköpstransaktionen genomfördes samma dag på en handelsplats krävs det inte heller att fälten för instrumentets referensuppgifter fylls i för rapporten för säljtransaktionen.

När dessa villkor inte är uppfyllda ska värdepappersföretag fylla i alla fälten 42–56 som är relevanta för instrumentet.

Dock ska behöriga myndigheter inte avvisa transaktionsrapporten om värdepappersföretag fyller i fälten avseende referensuppgifter för instrumentet när instrumentet handlas på en handelsplats eller finns i Esmas förteckning.

²⁴ I de ovanliga situationer där ett värdepappersföretag underlåter att skicka referensuppgifter för instrumentet.

5.7.2 Inlämnande av transaktionsrapporter

Enligt artikel 26.7 i MIFIR kan ett värdepappersföretag förlita sig på att en handelsplats rapporterar informationen om marknadssidan av en transaktion som genomförs på en handelsplats. Handelsplatser kan även erbjuda tjänsten att rapportera informationen från kundsidan av en transaktion som inte utförs via deras system, förutsatt att de registrerar sig som en ARM.

När en handelsplats inger rapporter för ett värdepappersföretags räkning ska den lämna informationen till den behöriga myndighet till vilken värdepappersföretaget är skyldig att lämna den, oberoende av var handelsplatsen är belägen.

När en handelsplats inger rapporter för transaktioner som genomförts av ett företag enligt artikel 26.5 i MIFIR ska den lämna informationen till den behöriga myndigheten i sitt hemland.

5.7.2.1 Frist för ingivande av transaktionsrapporter

5.7.2.1.1 Rapporteringstidpunkt

Transaktioner ska nå den behöriga myndigheten i värdepappersföretagets hemland²⁵ senast 23:59:59 lokal tid den arbetsdag som följer efter transaktionsdagen (dvs. för transaktioner som utförs dag T ska transaktioner rapporteras senast 23:59:59 dag T+1). Värdepappersföretag kan även rapportera detaljer från sina transaktioner som genomförs dag T samma dag (dvs. på dag T) oberoende av huruvida rapporterna upprättas direkt av värdepappersföretag eller av en ARM som handlar för deras räkning eller av den handelsplats genom vars system transaktionen slutfördes. Detta innebär att företag ska inge informationen till handelsplatsen eller ARM i tid för att handelsplatsen eller ARM ska kunna inge rapporten till den behöriga myndigheten inom fristen T+1.

5.7.2.1.2 Arbetsdag

Alla veckodagar är arbetsdagar förutom lördagar och söndagar och förutom alla officiella nationella helgdagar i den nationella behöriga myndighetens medlemsstat till vilken transaktionsrapporten lämnas in.

Del II – Block

5.8 Block 1: Identifiering av köpare/säljare

Behöriga myndigheter är intresserade av vem som är den underliggande kunden för att undvika marknadsmissbruk, snarare än av äganderättsliga skäl. Om det föreligger en rörelse som medför en ändring av en kunds äganderätt ska kunden därför rapporteras som köpare/säljare när det är lämpligt, snarare än en förvaltare eller ett ombud som eventuellt har den juridiska äganderätten. Emellertid, förutom för vidarebefordran när villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 är uppfyllda, vilket omfattas av avsnitt 5.26.3, ska värdepappersföretag rapportera sin direkta kund. Värdepappersföretaget förväntas inte se bortom sin kund eller motpart för att försöka fastställa den slutgiltiga kunden. Till exempel, om ett värdepappersföretag inte har uppgifter om den eller de underliggande kunden/kunderna krävs det inte att det ser bortom trusten till den bakomliggande kunden, utan endast att det rapporterar trusten som köpare/säljare (vilken ska identifieras genom sin LEI). Om

²⁵ Eller, om handelsplatser rapporterar för medlemmar som inte är värdepappersföretag, till den behöriga myndigheten i handelsplatsens hemland.

värdepappersföretaget emellertid känner kunden och upprättar ett förvaltningsavtal såsom för självinvesterade personliga pensioner ska kunden rapporteras som köpare/säljare och inte trusten.

Observera att typfallen 5.8.1–5.10.1 nedan visar identifiering och ytterligare detaljer för köpare, men att samma tillvägagångssätt är tillämpligt på säljare.

5.8.1 Köpare/säljare som är berättigad till LEI

Detta är tillämpligt under följande omständigheter:

Köparen/säljaren är ett företag eller ett värdepappersföretag som är motpart på marknaden.

Köparen/säljaren är en central motpart (detta är tillämpligt när transaktionen äger rum på en handelsplats eller i en anonym orderbok med en central motpart).

Köparen/säljaren är ett värdepappersföretag som handlar som en systematisk internhandlare.

Köparen/säljaren är en kund som är berättigad till en LEI (se avsnitt 5.5 om identifiering av parter i del I).

Exempel 17

Värdepappersföretag X utför en transaktion för kund A som köper det finansiella instrumentet.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn		
10	Köpare – efternamn		
11	Köpare – födelsedatum		

5.8.2 Köparen/säljaren är en fysisk person

5.8.2.1 Köparen/säljaren är EES-medborgare (enkelt medborgarskap)

Enligt artikel 6 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska en fysisk person identifieras i en rapport baserad på en kombination av ISO 3166-1 alfa-2 landskoden som anger personens nationalitet, följt av den nationella identifieringskod som anges i bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 på grundval av personens nationalitet. Enligt artikel 7 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska transaktionsrapporten dessutom innehålla kundens fullständiga namn och födelsedatum om denne är en fysisk person.

Exempel 18

Värdepappersföretag X utför en transaktion för kund 2 som köper det finansiella instrumentet.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Jose Luis Rodriguez de la Torre	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ, DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn	"JOSE,LUIS"	
10	Köpare – efternamn	"RODRIGUEZ,DE LA TORRE"	
11	Köpare – födelsedatum	"1976-02-27"	

Den identifieringskod som ska användas bestäms av personens nationalitet, snarare än var denne är bosatt eller var värdepappersföretag X är beläget.

Eftersom investeraren är spansk medborgare är identifieringskoden skatteregistreringsnumret (Código de identificación fiscal) enligt bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Namnet enligt schemat "NIDN" hänvisar till användningen av kundens nationella identifieringskod. Värdet "CCPT" indikerar användningen av passnumret, medan en sammansättning av nationalitet, födelsedatum och förkortning av namnet identifieras som "CONCAT". De två exempel som följer efter detta avsnitt illustrerar alla tre användningarna.

5.8.2.2 Köparen/säljaren är inte EES-medborgare (enkelt medborgarskap)

Exempel 19

Värdepappersföretag X säljer, för egen räkning, ett finansiellt instrument till en kund.

Kunden är amerikansk medborgare, Paul O'Connor, bosatt i Portugal. Hans födelsedatum är den 4 mars 1941.

I enlighet med det som anges i bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska det amerikanska passnumret användas för att identifiera Paul O'Connor i transaktionsrapporten, eftersom det i transaktionsrapporterings syfte är nationaliteten som bestämmer vilken identifieringskod som ska användas, snarare än var personen är bosatt.

Paul O'Connors amerikanska passnummer är 123456789ZZ.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Paul O'Connor	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PAUL</FrstNm> <Nm>O'CONNOR</Nm> <BirthDt>1941-03-04</BirthDt> <Othr> <Id>US123456789ZZ</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>
9	Köpare – förnamn	"PAUL"	
10	Köpare – efternamn	"O'CONNOR"	
11	Köpare – födelsedatum	"1941-03-04"	

Om Paul O'Connor inte har något amerikanskt passnummer ska det CONCAT-nummer som genererats som US19410304PAUL#OCONN anges i fält 7.

5.8.2.3 Köparen/säljaren har dubbelt medborgarskap (två EES-stater)

Exempel 20

Värdepappersföretag X utför en transaktion för en kund.

Kunden, Anne-Marie Berg, som köper det finansiella instrumentet, är svensk och fransk medborgare och hennes födelsedatum är den 3 december 1963.

I enlighet med kraven i artikel 6.3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 kommer ISO 3166 alfa-koden för Frankrike (FR) i alfabetisk ordning före Sveriges (SE). Därför ska det första prioriterade numret för Frankrike användas, vilket är CONCAT-koden (bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590), snarare än det svenska personnummer. CONCAT-numret är FR19631203ANNEMBERG#. Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Anne-Marie Berg	<pre> <TxRpt> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>ANNE-MARIE</FrstNm> <Nm>BERG</Nm> <BirthDt>1963-12-03</BirthDt> <Othr> <Id>FR19631203ANNEMBERG#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn	"ANNE-MARIE"	
10	Köpare – efternamn	"BERG"	
11	Köpare – födelsedatum	"1963-12-03"	

5.8.2.4 Köparen/säljaren har dubbelt medborgarskap (en EES-stat och en stat som inte tillhör EES)

Exempel 21

Värdepappersföretag X utför en transaktion för en kund, David Ștefan, som köper det finansiella instrumentet. Kunden har australiskt och rumänskt medborgarskap och hans födelsedatum är den 8 maj 1952.

Enligt artikel 6.3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 har EES-medborgarskapet företräde och därför ska det rumänska nationella identifieringsnumret (Cod Numeric Personal) användas.

Det rumänska nationella identifieringsnumret för David Ștefan är 1234567890123.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för David Ștefan	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>DAVID</FrstNm> <Nm>ȘTEFAN</Nm> <BirthDt>1952-05-08</BirthDt> <Othr> </pre>
9	Köpare – förnamn	"DAVID"	
10	Köpare – efternamn	"ȘTEFAN"	
11	Köpare – födelsedatum	"1952-05-08"	

			<Id>RO1234567890123</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>
--	--	--	---

I exemplet ovan ska det rumänska passnumret användas om personen inte har något rumänskt nationellt identifieringsnummer. Om personen inte har något pass ska CONCAT-koden användas. CONCAT-koden är RO19520508DAVIDSTEFAN.

5.9 Block 2: Köparens/säljarens beslutfattare

Typfallen nedan visar identifieringen av köparens beslutfattare, men samma tillvägagångssätt är tillämpligt på säljarens beslutfattare.

Såsom specificeras i tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är fälten avseende köparens beslutfattare (fälten 12–15) enbart tillämpliga när kunden är köparen och investeringsbeslutet fattas med befogenhet att företräda köparen. Denna befogenhet att företräda hänför sig till en tredje part eller tredje parter som är externa i förhållande till kunden och har erhållit befogenhet att fatta investeringsbeslut för kundens räkning. Dessa tredje parter kan sakna anknytning till det genomförande värdepappersföretaget eller kan vara värdepappersföretaget självt. Befogenhet att företräda kan beviljas av en kund som är en fysisk person eller en juridisk person, och personer som har beviljats befogenhet att agera för kundens räkning kan också vara fysiska eller juridiska personer.

Om värdepappersföretaget är den tredje parten ska dess identitet anges i fält 12 i stället för individuella beslutfattare i detta värdepappersföretag (den individuella beslutfattaren omfattas av fält 57).

Detta är tillämpligt under följande omständigheter:

När den person som har befogenhet att företräda ger instruktioner till värdepappersföretaget (detta omfattar ett avtal om fullmakt), eller

i enlighet med en diskretionär fullmakt som köparen har tilldelat det utförande värdepappersföretaget.

När en köpare/säljare har beviljat mer än en person befogenhet att företräda ska enbart den person eller de personer som gav instruktioner till värdepappersföretaget anges i fältet avseende beslutfattare.

Under alla andra omständigheter presumeras köparen att vara beslutfattaren och i dessa fall ska de fält som avser beslutfattare (fälten 12–15) inte fyllas i. Detta gäller även situationer när det föreligger ett avtal om fullmakt men köparen har fattat beslutet om den särskilda transaktionen i stället för den person eller de personer som innehar fullmakten.

Rekommendationer och råd utgör inte investeringsbeslut och således ska fältet avseende beslutsfattare inte fyllas i om det enbart föreligger en rekommendation eller ett råd.

Vad gäller den särskilda situationen för fonder och förvaltningsföretag ska fondförvaltaren identifieras som köpare/säljare av det värdepappersföretag som utför ordern och fältet avseende beslutsfattare ska inte fyllas i så länge det inte finns någon vidarebefordran som uppfyller kraven i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (se avsnitt 5.27.1).

5.9.1 Köparen/säljaren är beslutsfattare

Exempel 22

Värdepappersföretag X utför en transaktion för kund A som köper det finansiella instrumentet. Beslutet att köpa fattas av kund A.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera uppgifterna om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn		
10	Köpare – efternamn		
11	Köpare – födelsedatum		
12	Kod för beslutsfattare för köpet		
13	Beslutsfattare för köpet – förnamn		
14	Beslutsfattare för köpet – efternamn		
15	Beslutsfattare för köpet – födelsedatum		

Eftersom investeringsbeslutet har fattats av köparen ska fälten avseende beslutsfattare inte fyllas i.

5.9.2 Beslutsfattare är en tredje part med befogenhet att företräda köparen/säljaren

5.9.2.1 Beslutsfattare är en part med fullmakt

Exempel 23

Värdepappersföretag X utför en transaktion för sin kund Sean Murphy som köper det finansiella instrumentet.

Sean Murphy är irländsk medborgare och hans födelsedatum är den 27 februari 1976. Sean Murphy har gett sin advokat Thomas MacCormack, som är irländsk medborgare och född den 12 december 1951, fullmakt över sitt konto. Ordern lades av Thomas MacCormack.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera uppgifterna om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Sean Murphy	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>SEAN</FrstNm> <Nm>MURPY</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>IE19760227SEAN#MURPH</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>THOMAS</FrstNm> <Nm>MACCORMACK</Nm> <BirthDt>1951-12-12</BirthDt> <Othr> <Id>IE19511212THOMAMACCO</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn	"SEAN"	
10	Köpare – efternamn	"MURPHY"	
11	Köpare – födelsedatum	"1976-02-27"	
12	Kod för beslutsfattaren för köpet	{NATIONAL_ID} för Thomas MacCormack	
13	Beslutsfattare för köpet – förnamn	"THOMAS"	
14	Beslutsfattare för köpet – efternamn	"MACCORMACK"	
15	Beslutsfattare för köpet – födelsedatum	"1951-12-12"	

Eftersom Sean Murphy och Thomas MacCormack båda är irländska medborgare ska CONCAT-koden användas, eftersom den utgör första prioritetsnivån för Irland. Den ska vara IE19760227SEAN#MURPH respektive IE19511212THOMAMACCO.

5.9.2.2 Beslutsfattaren är ett värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt från köparen/säljaren

Exempel 24

Värdepappersföretag X utför en transaktion för en kund i enlighet med en diskretionär fullmakt. Således fattar värdepappersföretag X investeringsbeslutet för kundens räkning. Kunden, Pepe Torres Blanco, är mexikansk medborgare med passnummer MMM23654Z och är född den 20 maj 1968.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera uppgifterna om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Pepe Torres Blanco	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PEPE</FrstNm> <Nm>TORRES, BLANCO</Nm> <BirthDt>1968-05-20</BirthDt> <Othr> <Id>MXMMM23654Z</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn	"PEPE"	
10	Köpare – efternamn	"TORRES", "BLANCO"	
11	Köpare – födelsedatum	"1968-05-20"	
12	Kod för beslutsfattaren för köpet	{LEI} för värdepappersföretag X	
13	Beslutsfattare för köpet – förnamn		
14	Beslutsfattare för köpet – efternamn		
15	Beslutsfattare för köpet – födelsedatum		

5.10 Block 3 (kombination av 1 och 2): Särskilda scenarier för köpare/säljare och beslutsfattare

Såsom i de tidigare blocken visar typexemplen identifiering och ytterligare uppgifter för köpare, men samma tillvägagångssätt är tillämpligt på säljare.

5.10.1 Köpare/säljare är ett gemensamt konto

Exempel 25

Värdepappersföretag X utför en transaktion för ett gemensamt konto som innehas av makarna Pierre DuPont och Marie DuPont. Pierre DuPont är fransk medborgare och född den 27 februari 1976. Hans fru Marie är polsk medborgare med födelsedatum den 17 januari 1977 och nationellt identifieringsnummer (PESEL) 1234567890. Investeringsbeslutet har fattats av företrädaren för det gemensamma kontot, Charles Owen, vars födelsedatum är den 11 oktober 1968. Charles Owen är sydafrikansk medborgare (passnummer 1111222233334).

Det gemensamma kontot köper det finansiella instrumentet.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om köparen?

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för Pierre DuPont {NATIONAL_ID} för Marie DuPont	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PIERRE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>FR19760227PIERRDUPON</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>MARIE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1977-01-17</BirthDt> <Othr> <Id>PL12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>CHARLES</FrstNm> <Nm>OWEN</Nm> <BirthDt>1968-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ZA1111222233334</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Köpare – förnamn	"PIERRE"	
10	Köpare – efternamn	"DUPONT"	
11	Köpare – födelsedatum	"1976-02-27"	
12	Kod för beslutsfattaren för köpet	{NATIONAL_ID} för Charles Owen	
13	Beslutsfattare för köpet – förnamn	"CHARLES"	
14	Beslutsfattare för köpet – efternamn	"OWEN"	
15	Beslutsfattare för köpet – födelsedatum	"1968-10-11"	

Fälten 7–11 måste upprepas för varje köpare.

Beslutsfattaren agerar för det gemensamma kontot snarare än för varje enskild person och ska därför enbart fyllas i en gång.

5.10.2 Säljaren är avliden

Vid transaktioner som kommer från ett dödsbo för avlidna kunder eller arv ska den avlidna personen rapporteras som säljare. Den avlidna personen anses vara beslutsfattare och såldes ska fälten avseende beslutsfattare inte fyllas i. När en part ärver finansiella instrument ska den rapporteras som köpare. Den part som ärver ska anses vara beslutsfattare och fälten avseende beslutsfattare ska inte fyllas i.

5.11 Block 4: Fältet för investeringsbeslut inom företaget

5.11.1 Fältet för investeringsbeslut inom företaget

Såsom föreskrivs i artikel 8.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska detta fält alltid fyllas i när värdepappersföretaget handlar för egen räkning, eftersom dess böcker utsätts för risken och det därför anses fatta ett investeringsbeslut. Det enda undantaget föreligger i samband med vidarebefordran när värdepappersföretaget rapporterar i egenskap av mottagande värdepappersföretag och handlar för egen räkning, i vilket fall det, i enlighet med fält 57, ska fylla i den information som tillhandahållits av det vidarebefordrande värdepappersföretaget i rapporten avseende kundsidan (se avsnitten 5.26.3.1, 5.26.4.1, 5.26.4.2 och 5.27.2).

Vidare ska detta fält, enligt artikel 8.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, även fyllas i när värdepappersföretaget fattar ett investeringsbeslut för en kund i enlighet med en diskretionär fullmakt – (se avsnitt 5.27.1).

Exempel 26

Värdepappersföretag X köper ett finansiellt instrument.

Handlare 1 är den person inom värdepappersföretaget som huvudsakligen är ansvarig för investeringsbeslutet.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera investeringsbeslutet i fältet för investeringsbeslut inom företaget?

N	Fält	Värden	XML
57	Investeringsbeslut inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 1	<pre> <Tx> <New> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </pre>

			<code></InvstmtDcsnPrsn></code> ... <code></New></code> <code></Tx></code>
--	--	--	---

Observera att, till skillnad från uppgifterna om köparen, krävs det inte några uppgifter om vilken särskild person som är ansvarig för investeringsbeslutet inom värdepappersföretaget. Den enda information som krävs är personens nationella identifieringskod.

Om en algoritm inom värdepappersföretaget huvudsakligen är ansvarig för investeringsbeslutet ska fält 57 fyllas i med algoritmens kod.

5.11.2 Investeringsbeslutet fattas utanför företaget (kunden fattar investeringsbeslutet och värdepappersföretaget handlar på grundval av en matchad principalkapacitet eller "annan kapacitet")

Exempel 27

Värdepappersföretag X handlar på grundval av en matchad principalkapacitet eller "annan kapacitet" och köper ett finansiellt instrument för en kund på rent verkställande eller rådgivande grund.

Investeringsbeslutet anses ha fattats av kunden oberoende av huruvida värdepappersföretag X har rekommenderat det finansiella instrumentet till kunden, eftersom det i sista hand är kunden som har fattat investeringsbeslutet.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera investeringsbeslutet i fältet för investeringsbeslut inom företaget?

Eftersom värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet" eller på grundval av en matchad principalkapacitet ska varken fält 57 eller fält 12 fyllas i.

N	Fält	Värden	XML
57	Investeringsbeslut inom företaget		<code><Tx></code> <code><New></code> ... <code><FinInstrm></code> ... <code></FinInstrm></code> <code><ExctgPrsn></code> ... <code></ExctgPrsn></code> ... <code></New></code> <code></Tx></code> Om ett fält inte är ifyllt ska det aktuella XML-elementet (dvs. <code><InvstmtDcsnPrsn></code>) inte förekomma i meddelandet.

Om ett värdepappersföretag i stället handlar för egen räkning, även om transaktionen kan ha initierats av kunden, anses värdepappersföretag X ha fattat investeringsbeslutet och således ska fält 57 fyllas i, men inte fält 12.

5.12 Block 5: Fältet för utförande inom företaget

I varje transaktionsrapport ska fält 59 fyllas i. Om beslutet om utförande fattades av kunden (dvs. kunden ger instruktioner om handeln, inbegripet på vilken handelsplats den ska utföras) eller av en annan person utanför värdepappersföretaget (t.ex. en anställd från ett företag inom samma koncern) ska värdepappersföretaget använda standardvärdet "NORE" i detta fält.

Exempel 28

Värdepappersföretag X köper ett finansiellt instrument för en kunds räkning, och kunden har lämnat särskilda instruktioner om handeln.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera fältet för utförande inom företaget?

N	Fält	Värden	XML
59	Utförande inom företaget	"NORE"	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Om någon annan kod än "NORE" anges i fältet ska koden – såsom fastställs i artikel 9 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 – antingen utgöra identifieringskoden för en person inom värdepappersföretaget eller identifieringskoden för en algoritm inom värdepappersföretaget, beroende på vilken av dessa som huvudsakligen är ansvarig för utförandet. Detta är värdepappersföretagets ansvar att fastställa i enlighet med dess förvaltningsmodell.

5.12.1 En person har det huvudsakliga ansvaret för utförandet

Om en person har det huvudsakliga ansvaret för utförandet ska den personens nationella identifieringskod anges i fält 59.

5.12.2 En algoritm har det huvudsakliga ansvaret för utförandet

Exempel 29

När utförandet gjordes av en algoritm ska algoritmen rapporteras i fält 59 i tabell 2 i bilaga I i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Värdepappersföretag X köper ett finansiellt instrument och en algoritm från värdepappersföretag X (kod: 4567EFZ) är ansvarig för utförandet av denna transaktion.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera fältet för utförande inom företaget?

N	Fält	Värden	XML
59	Utförande inom företaget	{Algoritmens kod}	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Algo>4567EFZ</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Begreppet "algorithm" ska förstås som varje system som automatiskt utför transaktioner utan mänsklig inblandning. Även i detta fall ska en identifieringskod för det automatiska systemet anges.

5.13 Block 6: Datum och tidpunkt för handel

Det datum och den tidpunkt för handel som ska rapporteras ska vara den tidpunkt när transaktionen uppkommer och parterna är bundna av densamma, snarare än datum och tidpunkt för en efterföljande bekräftelse.

När ett värdepappersföretag skickar en order till ett företag utanför EES som utför ordern ska värdepappersföretaget vidta alla rimliga åtgärder för att erhålla det mest exakta datumet och tidpunkten.

För datum och tidpunkt för handel enligt fält 28 ska värdena inte avrundas och granularitetsnivån ska överensstämma med de krav som fastställs i fält 28 i tabell 2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Avseende detaljer om kraven på granularitet i transaktionsrapporter, se avsnitt 7.2 om tidsstämpel för granularitet.

5.14 Block 7: Handelsplats

Exemplen i detta block avser hur fältet avseende handelsplats och andra relevanta fält ska fyllas i för den direkta marknadstransaktionen. Observera att såsom förklaras i avsnitt 5.4.2 om "Rapportering av fältet avseende handelsplats för kedjor" ska endast det direkta utförandet från handelsplatsen²⁶ eller handelsplattformen eller den systematiska internhandlaren anses äga rum på en handelsplats. För exempel på hur fältet avseende handelsplats ska rapporteras i andra situationer, se 5.22–5.24 och 5.26–5.27 (scenarier med anknytning till multipla utföranden, grupporder, OTF som handlar med matchad principkapacitet och genomförande via en kedja av värdepappersföretag, vidarebefordran och värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt).

Detaljerna om hur transaktioner ska rapporteras för särskilda finansiella instrument föreskrivs i del IV.

²⁶ Detta omfattar situationer när handel som avtalas utanför handelsplatsen ska omfattas av bestämmelserna för denna handelsplats.

5.14.1 Utförande av en transaktion i en anonym orderbok på en handelsplats

Exempel 30

Värdepappersföretag X säljer finansiella instrument på en handelsplats. Transaktionen utfördes den 5 maj 2018 klockan 09:10:33.124373. Handelsplatsen genererar en identifieringskod för handelsplatstransaktioner (TVTIC) (ABCDEFGH123456).

a) Handelsplats M (som använder en central motpart).

b) Handelsplats B använder inte en central motpart och den förvärvande/avyttrande partens identitet avslöjades inte vid tidpunkten för utförandet. Dess MIC-segment är "XABC".

Hur ska värdepappersföretag X rapportera fältet avseende handelsplats och därmed sammanhängande fält?

N	Fält	Värden för scenario a)	Värden för scenario b)
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"ABCDEFGH123456"	"ABCDEFGH123456"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats B
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-05-05T09:10:33.124Z"	"2018-05-05T09:10:33.124Z"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats B

XML:

Rapport, scenario a)	Rapport, scenario b)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>ABCDEFGH123456</TradPlcMtgId> </Tx> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <MIC>XABC</MIC> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XABC</TradVn> <TradPlcMtgId>ABCDEFGH123456</TradPlcMtgId> </Tx> ... </pre>

<code></New></code> <code></Tx></code>	<code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>
---	---

5.14.2 Utförande av en transaktion på en handelsplattform utanför unionen i en icke-anonym orderbok

Exempel 31

Värdepappersföretag X säljer ett finansiellt instrument som ska rapporteras på en organiserad handelsplattform utanför unionen (MIC: XAAA) genom att acceptera en köporder från värdepappersföretag Y. Transaktionen utfördes den 10 september 2018 klockan 13:15:45.122469.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera fältet avseende handelsplats och därmed sammanhängande fält?

N	Fält	Värden	XML
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner		<code><Tx></code> <code><New></code> <code>...</code>
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> <code>></code>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	<code>...</code> <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Buyr></code>
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-10T13:15:45Z"	<code>...</code> <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-09-10T13:15:45Z</TradDt></code> <code>...</code>
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplattformen	<code><TradVn>XAAA</TradVn></code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>

Identifieringskoden för handelsplatstransaktioner är inte tillämplig i denna situation, eftersom transaktionen inte utförs på en handelsplats.

Värdepappersföretag X känner till motparten (värdepappersföretag Y) och således är motparten identifierad i transaktionsrapporten, i detta fall i egenskap av köpare.

Eftersom transaktionen inte äger rum på en handelsplats ska den granularitet som rapporteras för tiden vara i sekunder eller mer noggrant.

5.14.3 Utförande av en transaktion på en handelsplats genom acceptering av sin egen order i en anonym orderbok

Såsom påpekas i avsnittet 5.6 "Innebörd av transaktion" i del I är detta den situation som artikel 2.4 är avsedd att vara tillämplig på.

Exempel 32

Värdepappersföretag X som handlar för egen räkning accepterar sin egen order på handelsplats M, vilket genererar en identifieringskod för handelsplatstransaktioner (ABCDEFGH123456) för denna transaktion som utförs den 15 juli 2018 klockan 11:37:22.867415.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera fältet avseende handelsplats och därmed sammanhängande fält?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"ABCDEFGH123456"	"ABCDEFGH123456"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för CCP för handelsplats M
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-15T11:37:22.867Z"	"2018-07-15T11:37:22.867Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XABC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>ABCDEFGH123456</TradPlcM tchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XABC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>ABCDEFGH123456</TradPlcM tchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

5.14.4 En systematisk internhandlare utför en transaktion

Exempel 33

Värdepappersföretag Y vill sälja aktier. Värdepappersföretag X, som handlar som en systematisk internhandlare (SI), köper aktierna från värdepappersföretag Y. Transaktionen utfördes den 15 juli 2018 klockan 11:37:22.Z.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner		
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-15T11:37:22.Z"	"2018-07-15T11:37:22.Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för SI (värdepappersföretag X)	{MIC}-segment för SI (värdepappersföretag X)

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> <TradDt>2018-07- 15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>

5.15 Block 8: Flagging för blankning

Nedanstående typexempel är tillämpligt om värdepappersföretaget utför en blankning²⁷ av aktier som ska rapporteras eller statspapper inom tillämpningsområdet för artiklarna 12, 13 och 17 i förordning (EU) nr 236/2012, antingen för egen räkning eller för en kunds räkning. Värdepappersföretaget ska begära att kunden meddelar om det är fråga om blankning.

Om kunden inte lämnar information om blankning till värdepappersföretaget ska "UNDI" anges i fält 62.

Flaggning för blankning är tillämplig i de rapporter som visar transaktioner med de individuella kunderna snarare än för den ackumulerade marknadstransaktionsrapporten. Om båda kunderna eller en av kunderna utför en blankning ska blankningsindikatorn därför lämnas tom i den ackumulerade marknadstransaktionsrapporten, eftersom denna rapport inte hänför sig till en enskild kund, utan till alla kunder vars order har ackumulerats.

²⁷ Enligt definitionen i artikel 2.1 b i förordning (EU) nr 2346/2012.

För situationer där en ackumulering äger rum och hur flaggning för blankning ska tillämpas, se avsnitten 5.23, 5.24 och 5.27.2.

5.15.1 Kund till värdepappersföretag X utför en blankning (värdepappersföretag X har tillgång till denna information)

Exempel 34

Värdepappersföretag X säljer aktier för kund A:s räkning. Kund A utför en blankning.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om blankningen?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för kund A	
18	Säljare – förnamn		
19	Säljare – efternamn		
20	Säljare – födelsedatum		
62	Uppgift om blankning	"SESH"	

5.15.2 Värdepappersföretag X utför en blankning för egen räkning

Exempel 35

Värdepappersföretag X säljer statspapper för egen räkning.

5.15.2.1 Transaktionen äger rum enligt ett undantag

Transaktionen äger rum i enlighet med undantaget för marknadsgarantverksamhet och primärmarknadsoperationer enligt artikel 17 i förordning (EU) nr 236/2012.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om blankningen?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> </pre>

16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SSEX</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> ... </New> </Tx> </pre>
29	Handelskapacitet	"DEAL"	
62	Uppgift om blankning	"SSEX"	

5.15.2.2 Transaktionen äger inte rum i enlighet med något undantag

Transaktionen äger inte rum i enlighet med något undantag för marknadsgarantverksamhet eller primärmarknadsoperationer enligt artikel 17 i förordning (EU) nr 236/2012.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera informationen om blankningen?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
62	Uppgift om blankning	"SESH"	

5.16 Block 9: Uppgift om undantag, transparens efter handel för OTC och råvaruderivat

5.16.1 Uppgift om undantag och transparens efter OTC-handel

Fält 61 ska fyllas i av det värdepappersföretag som ingav ordern till handelsplatsen eller upprättade en rapport om handeln till handelsplatsen.

Ett värdepappersföretag ska inte fylla i uppgift om transparens efter OTC-handel "CANC" i fält 63, eftersom skyldigheten att tillhandahålla uppgifter om transparens efter OTC-handel enligt artikel 26.3 förutsätter att det föreligger en transaktion i den mening som avses i artikel 26 i MiFIR såsom definieras i artikel 2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, och en annullering anses inte utgöra en transaktion i den mening som avses i artikel 26 i MiFIR.

5.16.1.1 Transaktion som utförs på en handelsplats

Exempel 36

Värdepappersföretag X utför en transaktion för en kund genom handel för egen räkning. Instrumentet är ett aktieinstrument. Värdepappersföretag X köper det finansiella instrumentet på handelsplats M och säljer det sedan till kunden.

Köpet på handelsplatsen utförs enligt undantaget för transaktioner till referenspris i enlighet med artikel 4 i MiFIR. Försäljningen till kunden är av stor omfattning i enlighet med artikel 20.3 a i MiFIR.

Eftersom marknadssidan av transaktionen utförs på en handelsplats ska värdepappersföretag X rapportera undantaget i fältet avseende uppgift om undantag. Värdepappersföretag X ska även rapportera uppgifter om transparens efter OTC-handel för kundsiden av transaktionen.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera undantaget och uppgifterna om transparens efter OTC-handel?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
61	Uppgift om undantag	"RFPT"	
63	Uppgift rörande transparens efter handel för OTC		"LRGS"

XML:

Rapport #1 (rapport om marknadssidan)	Rapport #2 (rapport om kundsiden)
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>	<Tx> <New>

<pre> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <WvrInd>RFPT</WvrInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---

5.16.1.2 Transaktion som utförs OTC

Exempel 37

Värdepappersföretag X utför en OTC-transaktion med värdepappersföretag Y i ett aktieinstrument. Såväl värdepappersföretag X som värdepappersföretag Y handlar för egen räkning. Transaktionens storlek är sådan att den kan anses vara av stor omfattning.

Eftersom transaktionen genomförs OTC är endast fältet avseende uppgift rörande transparens efter handel för OTC tillämpligt.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"
61	Uppgift om undantag		
63	Uppgift rörande transparens efter handel för OTC	"LRGS"	"LRGS"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... </pre>

<pre> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--

5.16.1.3 Transaktionen utförs utanför orderboken men enligt handelsplatsens regler

Exempel 38

Värdepappersföretag X utför en transaktion för kund A:s räkning genom att köpa ett aktieinstrument från företag Y. Transaktionen äger rum utanför orderboken men enligt reglerna för handelsplats M. Transaktionen utförs enligt ett undantag för ett "manuellt avslut i illikvida finansiella instrument" i enlighet med artikel 4.1 b ii i MiFIR.

Värdepappersföretag Y är medlem i handelsplatsen och har upprättat en rapport avseende handeln till handelsplatsen som sedan har offentliggjort uppgifter rörande transparens efter handel för transaktionen.

Värdepappersföretag Y och kund A handlar för egen räkning.

Värdepappersföretag Y ska fylla i indikatorn för undantag i transaktionsrapporten, eftersom det har rapporterat handeln till handelsplatsen och värdepappersföretag X kan även fylla i uppgifterna om undantag om det har den informationen.

Eftersom transaktionen mellan X och Y ägde rum enligt handelsplatsens regler ska uppgift rörande transparens efter handel för OTC inte anges i deras rapporter, eftersom detta endast är tillämpligt på transaktioner som inte genomförs på en handelsplats.

Kund A ska inte fylla i uppgift rörande transparens efter handel för OTC eftersom denne inte rapporterar marknadssidan av en transaktion på handelsplatsen. Uppgifter om transparens efter handel för OTC ska under inga omständigheter fyllas i av kund A, eftersom detta inte utgör en separat OTC-transaktion utan är en kunddel som är kopplad till ett genomförande på marknaden, dvs. är del av en kedja.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y och kund A rapportera om kund A är ett värdepappersföretag?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y	Värderapport kund A
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för kund A
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
61	Uppgift om undantag		"OILQ"	
63	Uppgift rörande transparens efter handel för OTC			

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y	Rapport från kund A
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAAA</LEI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</L EI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAAA</LEI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012345678 90</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</Tradg Cpcty> </pre>

...	<TradVn>XMIC</TradVn>	...
<TradVn>XMIC</TradVn>	</Tx>	<TradVn>XOFF</TradVn>
...	...	</Tx>
</Tx>	<AddtlAttrbts>	...
...	<WvrInd>OILQ</WvrInd>	</New>
</New>	...	</Tx>
</Tx>	</AddtlAttrbts>	
	</New>	
	</Tx>	

5.16.2 Uppgift om transparens efter handel när ett värdepappersföretag matchar två kundorder OTC

Se avsnitt 5.20.

5.16.3 Uppgift om råvaruderivat

5.16.3.1 När en kund har angett att den minskar sina risker

Exempel 39

Värdepappersföretag X har utfört en transaktion för kunds räkning, kund 3 som är en icke-finansiell enhet, i ett råvaruderivat såsom det definieras i artikel 2.1.30 i MiFIR, där kund A har uppgett att den minskar sina risker på ett objektivet mätbart sätt i enlighet med artikel 57 i direktiv 2014/65/EU. Värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet".

Hur ska värdepappersföretag X rapportera uppgifterna om råvaruderivat?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	XML
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
64	Uppgift om råvaruderivat	"true"	<Tx> <New> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Om kund 3 inte har meddelat värdepappersföretag X att den minskar sin risk på ett objektivet mätbart sätt i enlighet med artikel 57 i direktiv 2014/65/EU ska värdepappersföretag X ange "false" i fält 64.

5.16.3.2 Om instrumentet inte är ett råvaruderivat

Exempel 40

Värdepappersföretag X har utfört en transaktion för kund 3:s räkning i ett instrument som inte är ett råvaruderivat enligt artikel 2.1.30 i förordning (EU) nr 600/2014.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera uppgifterna om råvaruderivat?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	XML-återgivning
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
64	Uppgift om råvaruderivat		<pre> <Tx> <New> ... <Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Eftersom instrumentet inte är ett råvaruderivat enligt artikel 2.1.30 i MiFIR är fält 64 inte tillämpligt och ska inte fyllas i.

5.17 Block 10: Filialer

5.17.1 Transaktion som utförs för en kunds räkning

Exempel 41

Ett nederländskt värdepappersföretag, värdepappersföretag D, har en LEI på 13579135790246802468. Det har filialer i Paris (FR), London (GB) och Frankfurt (DE). Det erhåller en order från en spansk kund, kund E, genom sin handlare 7, att köpa ett särskilt finansiellt instrument. Kund E har en LEI på 24242424242424242424. Kunden skickar ordern till filialen i Paris. Filialen i Paris vidarebefordrar ordern till handlarbordet i London. Handlare 8 som övervakas av Londonfilialen beslutar att utföra ordern på handelsplats M. Handlare 7, Jean Bernard, är fransk medborgare med födelsedatum den 4 maj 1972. Handlare 8 är brittisk medborgare med brittiskt, nationellt försäkringsnummer QQ123456C. Medlemskapet vid handelsplats M innehas av filialen i Frankfurt²⁸.

Transaktionsrapporten ingavs till AFM (NL).

Hur ska värdepappersföretag D och kund E rapportera fälten avseende filialer om det antas att kund E är skyldig att rapportera transaktionen och handlar för egen räkning?

²⁸ I vissa rättsordningar är det möjligt och i vissa fall även det normala förfarandet att en (lokal) filial innehar medlemskapet på marknaden.

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag D	Värderapport kund E
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag D	{LEI} för kund E
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund E	{LEI} för kund E
8	Land där köparens filial är belägen	"FR"	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för företag D
17	Land där säljarens filial är belägen		
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
37	Land för filialens medlemskap	"DE"	
57	Investeringsbeslut inom företaget		{NATIONAL_ID} för "handlare 7"
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet		"ES"
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för "handlare 8"	{NATIONAL_ID} för "handlare 7"
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"GB"	"ES"

XML:

Rapport från värdepappersföretag D	Rapport från kund E
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>13579135790246802468</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>242424242424242424</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>24242424242424242424</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>13579135790246802468</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </pre>

<pre> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>QQ123456C </Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Fält 17 ska inte fyllas i av varken värdepappersföretag D eller kund E, eftersom detta fält enbart ska fyllas i om en kund från det utförande värdepappersföretaget anges i fältet för säljaren. På motsvarande sätt ska fält 8 inte anges i transaktionsrapporten från kund E, eftersom kund E inte har angett någon underliggande kund i fält 7.

Fält 57 är tomt i rapporten från värdepappersföretag D, eftersom värdepappersföretag D handlar enligt "annan kapacitet". Det krävs inte att värdepappersföretag D fyller i fält 58 i sin rapport, eftersom fält 57 är tomt.

I fält 58 ska kunden fylla i landskoden för huvudkontoret för kund E (ES), eftersom ingen filial var inblandad.

5.17.2 Transaktion som utförs för egen räkning

Exempel 42

Handlare 7 som övervakas av huvudkontoret för det spanska värdepappersföretaget E, vars LEI är 12312312312312312312 och som har filialer i Paris (FR), London (GB) och Frankfurt (DE) beslutar att sälja ett visst finansiellt instrument. Handlare 7 beslutar att utföra ordern på handelsplats M. Medlemskapet på handelsplats M innehas av filialen i Frankfurt.

Transaktionsrapporten inges till CNMV (den spanska finansinspektionen) (ES).

Hur ska värdepappersföretag E rapportera fälten för filialerna?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag E	<Tx> <New> ...
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	<ExctgPty>12312312312312312312</ExctgPty> ...
8	Land där köparens filial är belägen		<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för företag E	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12312312312312312312</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
17	Land där säljarens filial är belägen		...
29	Handelskapacitet	"DEAL"	<Tx> ...
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	<TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ...
37	Land för filialens medlemskap	"DE"	<TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> ...
57	Investeringsbeslut inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 7	</Tx> ...
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet	"ES"	<InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn>
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 7	<ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr>
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"ES"	

			<pre> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Fält 17 ska lämnas tomt, eftersom detta fält endast ska fyllas i när säljaren anges vara en kund.

5.17.3 Transaktion som utförs av EES-filialer till företag som inte tillhör EES

Exempel 43

En handlare som övervakas av huvudkontoret för ett amerikanskt företag, företag F, med LEI 22222222222222222222 och med filialer i Paris (FR), London (GB) och Frankfurt (DE) beslutar att köpa ett visst finansiellt instrument. Handlaren utför transaktionen på handelsplats M. Medlemskapet vid handelsplats M innehas av filialen i Frankfurt. Företaget handlar för egen räkning.

Hur ska företag F rapportera fälten för filialer?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag F	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för företag F	<pre> <ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> </pre>
8	Land där köparens filial är belägen		<pre> ... </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>22222222222222222222</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>
17	Land där säljarens filial är belägen		<pre> </Buyr> </pre>
29	Handelskapacitet	"DEAL"	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	<pre> </Sellr> </pre>
37	Land för filialens medlemskap	"DE"	<pre> ... </pre>
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet	"US"	<pre> <Tx> ... </pre>
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"US"	<pre> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx> ... </pre>

			<pre> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Fälten 8 och 17 (land där köparens/säljarens filial är belägen) är tomma, eftersom dessa fält enbart ska fyllas i när kunder är angivna som köpare eller säljare.

För transaktionsrapportering krävs att ett beslut tas i förväg om till vilken behörig myndighet transaktionsrapporten ska inges. Det krävs inte att den behöriga myndigheten är den behöriga myndighet som har auktoriserat de filialer som är inblandade i transaktionen, men det ska vara en av de behöriga myndigheter som har auktoriserat en filial till företaget i enlighet med det gemensamma valet från företaget i tredjeland enligt artikel 14 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. I exemplet ovan kan transaktionsrapporten inges till de behöriga myndigheterna i UK, FR eller DE.

Enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är en EES-filial till ett företag utanför EES som utför verksamhet som föreskrivs i artikel 3 en utförande filial och ska rapportera transaktionen. I denna situation är det den tyska filialen som är utförande eftersom den handlar på marknaden och således ska transaktionsrapporten från företag F fyllas i såsom anges ovan.

5.18 Block 11: Transaktionsrapporternas status och rättelser

Statusen "NEWT" i fält 1 används för en transaktion som ännu inte har rapporterats och vid en rättelse av en felaktig transaktionsrapport efter annullering av den ursprungliga transaktionsrapporten.

Statusen "CANC" används för att annullera transaktionsrapporter för transaktioner som inte ska rapporteras och för att annullera transaktionsrapporter som innehåller fel innan en ersättningsrapport upprättas.

Transaktionsreferensnummer (nedan kallade *TRN*) ska vara unika för det utförande värdepappersföretaget och för varje transaktionsrapport. Om en eller flera ARM är inblandade ska transaktionen referensnummer alltid genereras på det utförande värdepappersföretagets nivå. Ett TRN får inte användas igen, förutom om den ursprungliga transaktionsrapporten har rättats eller annullerats, i vilket fall samma transaktionsreferensnummer ska användas i ersättningsrapporten som i den ursprungliga rapport som ersätts (se avsnitten 5.18.3 och 5.18.4). Detta TRN ska användas igen för varje efterföljande rättelse av samma transaktionsrapport. Det kan hända att det finns mer än en post (ny eller annullering) som hänför sig till samma transaktion (med samma transaktionsreferensnummer och samma identifieringskod för den utförande enheten) som ska omfattas av en enda fil. I detta fall ska ordningen på posterna i filen följa deras logiska behandlingsordning, dvs. att i) en transaktion endast kan annulleras som tidigare har rapporterats som en ny transaktion och ännu inte har annullerats och

ii) en transaktion kan endast inges med samma identifiering (samma transaktionsreferensnummer och identifieringskod för den utförande enheten) om den tidigare rapporten för denna transaktion har annullerats. I synnerhet ska följande situationer beaktas:

- En ny transaktion rapporteras och annulleras omedelbart (båda rapporterna inges i samma fil) -> den nya transaktionsrapporten ska inkluderas i filen före annulleringsrapporten.
- En transaktion som rapporterats i en av de tidigare filerna har annullerats och en ny version av denna övergång inges samtidigt (annullering av den tidigare rapporten och den nya versionen inges i samma fil) -> annulleringen av den tidigare transaktionsrapporten ska inkluderas i filen före den nya transaktionsrapporten (ny version av transaktionen).
- Kombination av omständigheterna ovan (dvs. mer än en ny eller en annullerad post som hör samman med en enda transaktion) -> beror på omständigheterna (a eller b ovan). Den första posten som inkluderas i filen ska antingen vara ny eller en annullering och de följande posterna ska ordnas så att varje post följs av en post av det motsatta slaget.

5.18.1 Annulleringar och ändringar intradag

När ett värdepappersföretag företar ett offentliggörande efter handel och annullerar detta offentliggörande efter handel innan någon transaktionsrapport har upprättats krävs inte något sådant upprättande.

Om ett värdepappersföretag företar ett offentliggörande efter handel innan någon transaktionsrapport upprättas krävs enbart att transaktionsrapporten reflekterar informationen vid det sista offentliggörandet efter handel.

5.18.2 Inlämnande av en ny transaktionsrapport

Exempel 44

Värdepappersföretag X utför en transaktion OTC den 10 mars 2018 klockan 12:45:30. Transaktionsrapporten inges genom en ARM, ARM 1 (LEI på ARM1ARM1ARM1ARM1). Transaktionsreferensnumret är ETYRU9753.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden ursprunglig rapport	XML
1	Rapportens status	"NEWT"	<code><Tx></code> <code><New></code> <code><TxId>ETYRU9753</TxId></code> <code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> <code>></code> <code>...</code> <code><SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1</code> <code>ARM1</SubmitgPty></code> <code>...</code> <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-03-</code> <code>10T12:45:30Z</TradDt></code>
2	Transaktionens referensnummer	"ETYRU9753"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för ARM 1	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-03-10T12:45:30Z"	

			<pre> </Tx> ... </New> </Tx> Observera att fält 1 inte existerar i meddelandet som ett XML-element. Tag New eller Cxl tag används i stället. </pre>
--	--	--	---

5.18.3 Inlämnande av en annullering

Exempel 45

Värdepappersföretag X inger en ny transaktionsrapport (detaljer som enligt avsnitt 5.18.2) genom att använda ARM 1 (LEI på ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1) och annullerar därefter transaktionsrapporten.

Observera att en annullering kan göras av en annan inlämnande enhet än den enhet som lämnade in den ursprungliga rapporten. Till exempel kan ett värdepappersföretag ha använt en ARM för att inge den ursprungliga rapporten och kan annullera rapporten själv eller använda sig av en annan ARM.

Vid annulleringar ska enbart de huvudsakliga fälten 1, 2, 4 och 6 fyllas i. Företag kan inte inge den fullständiga rapporten igen. Om transaktionsrapporten inges igen med ytterligare fält utöver de huvudsakliga fälten ska den avvisas.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden ursprunglig rapport	Värden annulleringsrapport
1	Rapportens status	"NEWT"	"CANC"
2	Transaktionens referensnummer	"ETYRU9753"	"ETYRU9753"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för ARM 1	{LEI} för ARM 1

XML:

Ursprunglig rapport	Annulleringsrapport
<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1 </SubmitgPty> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx> Observera att fält 1 inte existerar i meddelandet som ett XML-element. Tag New eller Cxl tag används i stället. </pre>

Observera att fält 1 inte existerar i meddelandet som ett XML-element. Tag New eller Cxl tag används i stället.

5.18.4 Rättelse av informationen i en transaktionsrapport

För att rätta någon uppgift i en transaktionsrapport krävs annullering av den ursprungliga rapporten och ingivande av en ny rapport.

Vid annulleringar ska enbart de huvudsakliga fälten 1, 2, 4 och 6 fyllas i. En transaktionsrapport rörande annullering som innehåller ytterligare fält än dessa fyra fält kommer att avvisas.

Ersättningsrapporten ska innehålla alla fält som är tillämpliga på transaktionen som rapporteras.

Exempel 46

Värdepappersföretag X har utfört en transaktion enligt 5.18.2 med ett pris på 5 GBP, men rapporterade transaktionen i den mindre i stället för den större valutaenheten (pence i stället för pund).

Transaktionsrapporten annulleras nästa dag klockan 14:50:20 och en ersättningsrapport inges vid samma tidpunkt för att rätta priset.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden ursprunglig rapport	Värden annulleringsrapport	Värden ersättningsrapport
1	Rapportens status	"NEWT"	"CANC"	"NEWT"
2	Transaktionens referensnummer	"ETYRU9753"	"ETYRU9753"	"ETYRU9753"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för ARM 1	{LEI} för ARM 1	{LEI} för ARM 1
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-03-10T12:45:30Z"		"2018-03-10T12:45:30Z"
33	Pris	"500"		"5"

XML:

Ursprunglig rapport	Annulleringsrapport	Ersättningsrapport
<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </pre>	<pre> <Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... </pre>

<pre> ... <Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">500</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Cxl> </Tx> </pre>	<pre> <SubmitgPty>ARM1ARM1A RM1ARM1ARM1</Submitg Pty> ... <Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---------------------------------------	---

Observera att datum och tid ska vara datum och tid för den ursprungliga transaktionen, dvs. "2018-03-10T12:45:30Z" och inte datum och tid för den rättade rapporten. Observera även, precis som i dessa riktlinjer som helhet, att den ursprungliga rapporten och ersättningsrapporten ska innehålla alla andra detaljer som är relevanta för transaktionen och att exemplen ovan endast visar utdrag från rapporterna.

5.19 Block 12: Teoretisk ändring

5.19.1 Teoretisk ökning

Exempel 47

Värdepappersföretag X säljer skydd till värdepappersföretag Y den 26 oktober 2018 klockan 08:21:01 för 2 miljoner euro i en kreditwap. Kreditswapen har en fast kupong med 100 räntepunkter och värdepappersföretag X har erhållit en förskottsbetalning på 50 000 euro. Värdepappersföretag X och företag Y handlar för egen räkning.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
2	Transaktionens referensnummer	"12456771"	"39998776"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-10-26T08:21:01Z"	"2018-10-26T08:21:01Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"

30	Kvantitet	"2 000 000"	"2 000 000"
32	Derivatets teoretiska ökning/minskning		
33	Pris	"100"	"100"
38	Förskottsbetalning	"50000"	"50000"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> <TxId>12456771</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-26T08:21:01Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">2000000</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">50000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998776</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10- 26T08:21:01Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">2000000</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">50000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Observera att förskottsbetalningen (fält 38) ska visa ett positivt värde i transaktionsrapporten från både värdepappersföretag X och företag Y, det företag som köper skyddet, eftersom säljaren av kreditswappen erhåller beloppet.

Den 25 november 2018 klockan 10:52:03 enas parterna i ovannämnda kreditswapavtal om en teoretisk ökning till 5 miljoner euro och om att fastställa att värdepappersföretag X ska erhålla en ytterligare betalning på 75 000 euro. Kupongbetalningarna påverkas inte.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera den teoretiska ökningen?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
2	Transaktionens referensnummer	"124567981"	"399987981"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-11-25T10:52:03Z"	"2018-11-25T10:52:03Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"3000000"	"3000000"
32	Derivatets teoretiska ökning/minskning	"INCR"	"INCR"
33	Pris	"100"	"100"
38	Förskottsbetalning	"75000"	"75000"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> <TxId>124567981</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>399987981</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </pre>

<pre> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <TradDt>2018-11- 25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

Transaktionsreferensnumret (fält 2) för denna transaktion är unik för ökningen och är inte detsamma som för den ursprungliga transaktionsrapporten.

Kvantiteten (fält 30) är det belopp som motsvarar den teoretiska ökningen. Om det sker en ändring i de kupongbetalningar som följer på den teoretiska ändringen ska den nya kupongen visas i fältet för pris (fält 33).

Observera att datum och tid är datum och tid för ökningen och inte datum och tid för den ursprungliga transaktionen.

Den ursprungliga transaktionsrapporten ska inte annulleras.

Den ursprungliga transaktionsrapporten och rapporten om den teoretiska ökningen visar tillsammans att värdepappersföretag X har sålt skydd till sin motpart för 5 miljoner euro.

5.19.2 Teoretisk minskning

5.19.2.1 Delvis uppsägning i förtid

Exempel 48

Såsom i det tidigare exemplet, men i stället för en teoretisk ökning den 25 november 2018 klockan 10:52:03, kommer parterna överens om en teoretisk minskning med 0,5 miljoner euro till 1,5 miljoner euro, med en betalning av 37 500 euro från värdepappersföretag X för minskningen.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
2	Transaktionens referensnummer	"124567852"	"39998792"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-11-25T10:52:03Z"	"2018-11-25T10:52:03Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"500000"	"500000"
32	Derivatets teoretiska ökning/minskning	"DECR"	"DECR"
33	Pris	"100"	"100"
38	Förskottsbetalning	"37500"	"37500"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> <TxId>124567852</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal> Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998792</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11- 25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal> Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> </pre>

<pre> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Förskottsbetalningen är positiv i båda rapporterna, eftersom även om värdepappersföretag X nu betalar i stället för att erhålla betalning, är Y säljare i denna rapport och således erhåller säljaren betalningen.

Eftersom exponeringen minskas och värdepappersföretag X ursprungligen sålde, köper nämnda företag nu i stället.

Kvantiteten (fält 30) är det belopp som motsvarar den teoretiska minskningen. Om det sker en ändring i de kupongbetalningar som följer på den teoretiska ändringen ska den nya kupongen visas i fältet för pris (fält 33).

Observera att datum och tid är datum och tid för minskningen och inte datum och tid för den ursprungliga transaktionen.

Den ursprungliga transaktionsrapporten och rapporten om den teoretiska minskningen visar tillsammans att värdepappersföretag X har sålt skydd för 1,5 miljoner euro. Den ursprungliga rapporten ska inte annulleras.

5.19.3 Fullständig uppsägning i förtid

Om parterna enas om en fullständig uppsägning av avtalet i förtid ska den teoretiska minskningen motsvara det fullständiga beloppet i det ursprungliga avtalet.

Del III – Handelsscenarier

5.20 Överföring av värdepapper

5.20.1 Överföring mellan kunder inom samma företag

Såsom föreskrivs i del I krävs ingen transaktionsrapport om den underliggande kundens äganderätt inte ändras. Denna princip är tillämplig oberoende av huruvida överföringen äger rum inom samma värdepappersföretag eller mellan två olika värdepappersföretag eller ett värdepappersföretag och ett företag, så länge ägaren är exakt densamma.

Om ett värdepappersföretag gör en överföring mellan konton som är en transaktion anses det ha genomfört en transaktion enligt artikel 3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Om värdepappersföretaget emellertid endast är inblandat för att tillhandahålla administrativ assistans och inte utför överföringen anses företaget inte genomföra transaktionen.

En överföring från ett konto som tillhör en kund till ett gemensamt konto där kunden är en av de gemensamma ägarna ska rapporteras. Det ska även rapporteras när ett gemensamt konto ändras till att vara ett konto med bara en ägare.

Denna princip är också tillämplig på överföringar från gemensamma portföljer till enskilda portföljer, distribution från truster till förmånstagare, överföringar från föräldrar som innehar konton för underåriga när de underåriga blir myndiga, överföringar (eller återköp) till ett företagsnamn som ägs av en enskild person från denna enskilda person, överföringar till välgörenhet och som ett resultat av auktioner eller från ett värdepappersföretag som matchar en köpare och en säljare.

Överföringar i samband med rörelser som uppkommer vid förvaltning av ett dödsbo för en avliden kund eller arv, auktioner eller gåvor ska alltid rapporteras, eftersom dessa transaktioner utgör förvärv och avyttringar där äganderätten ändras, även om det inte föreligger något pris, inbegripet ändringar av äganderätten till ett värdepapperskonto från en förmånstagare till en annan.

Fältet för priset ska spegla det pris som betalats, även om det kan skilja sig från marknadspriset. Om det sker en överföring av ett finansiellt instrument och inget pris betalas (t.ex. gåvor eller överföringar mellan fonder/portföljer) ska "NOAP" anges i fältet för priset.

Exempel 49

Kund A vill överföra instrument till kund B:s konto utan att någon betalning erhålls. Inga avgifter betalas. De båda kontona innehåller i samma värdepappersföretag (företag X) som utför överföringen.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera denna överföring?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund B	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för kund A	
33	Pris	"NOAP"	

			<pre> <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> – Observera att NOAP-koden ska användas när inget pris är tillämpligt. </pre>
--	--	--	---

Datum och tidpunkt när värdepappersföretag X genomförde överföringen ska rapporteras.

5.20.2 Överföring mellan kunder från två separata värdepappersföretag

Exempel 50

Kund A vill överföra 100 finansiella instrument från sitt konto hos värdepappersföretag X till kund B:s konto hos ett annat värdepappersföretag, företag Y. Instruktionerna från kund A ges till värdepappersföretag X och utförs den 5 oktober 2018 klockan 09:53:17. Varken värdepappersföretag X eller värdepappersföretag Y har kännedom om identiteten på varandras kunder.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för kund B
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-10-05T09:53:17Z"	"2018-10-05T09:53:17Z"
30	Kvantitet	"100"	"100"
33	Pris	"NOAP"	"NOAP"
34	Prisvaluta		

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> </pre>

<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</Exctg Pty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10- 05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> Note: NOAP code should be used when price is not applicable. </pre>	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> Note: NOAP code should be used when price is not applicable. </pre>
---	---

Värdepappersföretag X och värdepappersföretag Y ska rapportera vid vilken tidpunkt de genomförde överföringen och dessa tidpunkter kan skilja sig åt. Fält 28, datum och tidpunkt för handel, speglar datum och tidpunkt för transaktionen snarare än tidpunkten för vidarebefordran av order.

5.20.3 Företag som handlar OTC för att matcha två kundorder

Exempel 51

Värdepappersföretag X utför en transaktion OTC för kund A, köparen, och kund B, säljaren. Ingen av kunderna är skyldig att rapportera transaktionen. Handeln är föremål för offentliggörande efter handel med en uppgift rörande transparens efter handel för OTC fastställd till "ACTX" (korsvisa transaktioner genom ombud).

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifikationskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
7	Köparens identifikationskod	{LEI} för kund A	
16	Säljarens identifikationskod	{LEI} för kund B	
36	Handelsplats	"XOFF"	
63	Uppgift rörande transparens efter handel för OTC	"ACTX"	

Exempel 52

Värdepappersföretag X utför en transaktion OTC för kund A, köparen, och kund B, säljaren. Kund B är ett värdepappersföretag med skyldighet att rapportera transaktionen. Kund B har inte någon underliggande kund.

Hur ska värdepappersföretagen X och B rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag B
4	Identifikationskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag B
7	Köparens identifikationskod	{LEI} för kund A	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifikationskod	{LEI} för värdepappersföretag B	{LEI} för värdepappersföretag B

29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"
63	Uppgift rörande transparens efter handel för OTC	"ACTX"	

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>

Om kund A är ett värdepappersföretag med skyldighet att rapportera transaktionen ska det identifiera värdepappersföretag X som säljaren i sin transaktionsrapport.

5.21 Värdepappersföretag som förmedlar utan att träda emellan

5.21.1 Värdepappersföretag som matchar två order från kunder utan att träda emellan själva

Exempel 53

Värdepappersföretag X vill sälja ett visst instrument för egen räkning.

Värdepappersföretag Y vill köpa samma instrument för egen räkning.

Värdepappersföretag Z sammanför värdepappersföretagen X och Y men är inte part i transaktionen.

Värdepappersföretagen X och Y avtalar detaljerna för transaktionen sinsemellan.

Värdepappersföretag Z har ingen rapporteringsskyldighet, i stället är företagen X och Y rapporteringsskyldiga.

Vid tidpunkten för genomförandet har värdepappersföretag X kännedom om att Y är dess motpart.

Vid tidpunkten för genomförandet har värdepappersföretag Y kännedom om att X är dess motpart.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

5.21.2 Värdepappersföretag som förmedlar sin kund till ett annat värdepappersföretag utan att självt träda emellan

Exempel 54

Kund A vill köpa ett visst instrument. Mäklaren, företag X, handlar inte med sådana instrument utan förmedlar kund A till värdepappersföretag Y.

Värdepappersföretag Y köper de finansiella instrumenten för kund A på handelsplats M. Värdepappersföretag Y har vid tidpunkten för genomförandet kännedom om att kund A är dess kund och kund A har kännedom om förhållandet till värdepappersföretag Y för denna transaktion. Värdepappersföretag X medverkar inte vid genomförandet och erhåller endast provision för förmedlingen från värdepappersföretag Y.

Eftersom värdepappersföretag X inte har genomfört transaktionen ska det inte rapportera densamma.

Hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	

			</Sellr> ... </New> </Tx>
--	--	--	------------------------------------

Om kund A är ett värdepappersföretag ska det även rapportera genom att identifiera värdepappersföretag Y som säljare.

Detta skiljer sig från vidarebefordran som uppfyller villkoren i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, eftersom den underliggande kunden i detta scenario ingår ett avtal med det företag till vilket den förmedlas. Värdepappersföretag X överför effektivt detta avtal till värdepappersföretag Y. Detta skiljer sig från situationen där avtalet kvarstår med det överförande företaget och endast kundens uppgifter överförs.

5.22 En order för en kund som utförs genom flera transaktioner

5.22.1 Fyllande av kundens order genom utförande på en handelsplats och sedan tillhandahållande till kunden från värdepappersföretagets egen bok

Exempel 55



Client A	Kund A
Investment Firm X	Värdepappersföretag X
Trading Venue M	Handelsplats M

Kund A lägger en order om köp av 500 aktier till värdepappersföretag X.

Värdepappersföretag X utför ordern på handelsplats M i två omgångar, den ena den 24 juni 2018 klockan 14:25:13.159124 för 300 aktier för 99 SEK, och den andra den 24 juni 2018 klockan 15:55:13.746133 för 200 aktier för 100 SEK. Kunden önskar erhålla ett genomsnittspris.

a) Värdepappersföretag X handlar för egen räkning.

Transaktionerna bokas först i värdepappersföretag X:s egna böcker och bokas sedan till kunden klockan 16:24:12 samma dag till ett genomsnittligt volymviktat pris på 99,40 SEK.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T14:25:13.159Z"	"2018-06-24T15:55:13.746Z"	"2018-06-24T16:24:12Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"300"	"200"	"500"
33	Pris	"99"	"100"	"99,40"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:24:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>

<Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx>	<Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> ... </New> </Tx>	<Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.4</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </New> </Tx>
---	--	---

b) Värdepappersföretaget handlar på grundval av en matchad principalkapacitet

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för kund A
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M
20	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T14:25:13.159"	"2018-06-24T15:55:13.746"
29	Handelskapacitet	"MTCH"	"MTCH"
30	Kvantitet	"300"	"200"
33	Pris	"99"	"100"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr>

<pre> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-06- 24T14:25:13.159</TradDt> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-06- 24T15:55:13.746</TradDt> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

Även om kunden vill ha ett genomsnittspris krävs att transaktionsrapporten speglar att varje enskild order som utförs på marknaden omedelbart vidarebefordras till kunden, eftersom värdepappersföretaget handlar på grundval av en matchad principkapacitet.

c) Värdepappersföretaget handlar enligt "annan kapacitet"

Transaktionsrapporten från värdepappersföretag X, när det handlar enligt "annan kapacitet", är identisk med rapporten för matchad principkapacitet förutom att handelskapaciteten rapporteras som "AOTC" i stället för "MTCH".

5.22.2 Fyllande av kundens order genom erhållande av en del från en handelsplats och tillhandahållande av instrumenten till kunden från värdepappersföretagets egen bok

Exempel 56

Kund A lägger en order om köp av 600 aktier till värdepappersföretag X. Kunden vill erhålla ett genomsnittligt pris.

Värdepappersföretag X utför ordern från kund A på följande sätt:

- 1) Det utför två transaktioner på handelsplats M, den ena den 24 juni 2018 klockan 14:25:13.159124 för 300 aktier för 99 SEK, och den andra den 24 juni 2018 klockan 15:55:13.746133 för 200 aktier för 100 SEK.
- 2) Värdepappersföretag X tillhandahåller 600 aktier till kunden klockan 16:24:12 samma dag för ett genomsnittligt pris på 99,416 SEK.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2	Värderapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X
20	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T14:25:13.159Z"	"2018-06-24T15:55:13.746Z"	"2018-06-24T16:24:12Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"300"	"200"	"600"
33	Pris	"99"	"100"	"82,83333333333333"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"

XML:

Rapport #1 (marknadssidan)	Rapport #2 (marknadssidan)	Rapport #3 (kundsidan)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </pre>

<pre> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpct y> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:24:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">82.8333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--

5.23 Ackumulering av order

Det ackumulerade kundkontot (INTC) ska endast användas under de omständigheter som fastställs i dessa riktlinjer. Det ska inte användas för att rapportera en order för en kund som utförts genom en enda transaktion eller för en order för en kund som utförts genom flera transaktioner. När en överföring görs till INTC ska det göras en motsvarande överföring från det ackumulerade kundkontot inom samma handelsdag från den utförande enheten i transaktionsrapporten så att det ackumulerade kundkontot är stängt. Den synliga rörelsen via INTC är en teknik som används vid rapportering för att tillhandahålla en länk mellan transaktionens marknadssida och kundsida, och visar inte att ett sådant kundkonto existerar i verkligheten eller att äganderätten till instrumenten faktiskt överförs genom värdepappersföretagets böcker.

I artikel 11.2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 föreskrivs att blankningskraven enligt förordning (EU) nr 236/2012 är tillämpliga när ett värdepappersföretag ackumulerar order från flera kunder. Detta innebär att artikel 11.2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 enbart är tillämplig på de rapporter som visar transaktioner med individuella kunder och inte på ackumulerade marknadstransaktionsrapporter. I fall av en marknadstransaktionsrapport där försäljningar till kunder ackumuleras ska uppgifter om blankning inte fyllas i. Detta beror på att den ackumulerade transaktionsrapporten gäller alla kunder vars order har ackumulerats och uppgifterna om blankning inte kan specificeras med den granularitet som krävs. Uppgifterna om blankning för enskilda kunder rapporteras i stället i de individuella transaktionsrapporterna för kundsidan (se avsnitten 5.24 och 5.27.2).

5.23.1 Ett utförande på marknaden för flera kunder

Exempel 57

Två kunder till värdepappersföretag X, kunderna A och B, lägger säljorder för 100 respektive 200 aktier.

Kund A utför en blankning. Kund B underrättar inte värdepappersföretag X om huruvida den utför en blankning. Värdepappersföretag X:s positioner är stängda. Värdepappersföretag X ackumulerar dessa order och utför dem den 16 september 2018 klockan 09:20:15.374215 på handelsplats M genom en transaktion för 300 instrument för 25,54 euro. Kunderna tilldelas sedan klockan 09:35:10.

5.23.1.1 Värdepappersföretag X handlar för egen räkning

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-16T09:20:15.374Z"	"2018-09-16T09:35:10Z"	"2018-09-16T09:35:10Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"300"	"100"	"200"
33	Pris	"25,54"	"25,54"	"25,54"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"
62	Uppgift om blankning	"SESH"	"SESH"	"UNDI"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </pre>

</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... <Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-16T09:35:10Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... <Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
---	---	---

Eftersom en försäljning på marknaden skulle leda till att värdepappersföretag X får en kort position krävs att värdepappersföretag X fyller i rapport #1 för att ange detta, oberoende av det faktum att värdepappersföretag X:s positioner är stängda efter kundernas köp (se 5.27.2).

5.23.1.2 Värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet"

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	"INTC"	"INTC"
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-16T09:20:15.374Z"	"2018-09-16T09:20:15.374Z"	"2018-09-16T09:20:15.374Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"300"	"100"	"200"
33	Pris	"25,54"	"25,54"	"25,54"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"
62	Uppgift om blankning		"SESH"	"SELL"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> </pre>

<pre> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---	--

Pris, datum och tid för handel ska vara identiska i alla tre transaktionsrapporterna. Pris, datum och tid för handel utgörs av marknadspriset och datum och tid för utförandet på marknaden. Rapporterna #2 och #3 visar tilldelningen till kunderna av de transaktioner som genomförts på handelsplatsen enligt "annan kapacitet". Därför ska granulariteten för datum och tid från utförandet på marknaden kvarstå i rapporterna om tilldelning till kunden.

5.23.2 Flera utföranden på marknaden för flera kunder

Exempel 58

Tre kunder till värdepappersföretag X – kund A, kund B och kund C – lägger köporder för 100, 200 respektive 300 instrument.

Värdepappersföretag X har åtagit sig att ge kunderna ett genomsnittspris och ackumulerar ovanstående order samt utför dem i två omgångar på handelsplats M, en för 400 för 99 SEK (datum och tid: 15 september 2018 klockan 11:32:27.431) och en för 200 för 100 SEK (datum och tid: 15 september 2018 klockan 11:42:54.192). Det tilldelar instrumenten till kunderna klockan 12:15:23 samma dag.

5.23.2.1 Värdepappersföretag X handlar för egen räkning

Hur ska värdepappersföretag X rapportera marknadssidan av handeln?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X

7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:42:54.192Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"400"	"200"
33	Pris	"99"	"100"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:42:54. 192Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </pre>

</Tx>	... </Tx> ... </New> </Tx>
-------	--

Hur ska värdepappersföretag X rapportera handeln till kunderna?

N	Fält	Värderapport #3	Värderapport #4	Värderapport #5
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för kund C
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:42:54Z"	"2018-09-15T11:42:54Z"	"2018-09-15T11:42:54Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"100"	"200"	"300"
33	Pris	"99,33333333333333"	"99,33333333333333"	"99,33333333333333"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Rapport #3	Rapport #4	Rapport #5
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>

<pre> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:42:54Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:42:54Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 3</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:42:54Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Eftersom värdepappersföretag X handlar för egen räkning speglar datum och tid för rapporterna om kundsidan den tidpunkt vid vilken de finansiella instrumenten tilldelades kunderna.

5.23.2.2 Värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet"

Hur ska värdepappersföretag X rapportera marknadssidan av handeln?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	"INTC"
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:42:54.192Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"400"	"200"
33	Pris	"99"	"100"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:42:54.192Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Hur ska värdepappersföretag X rapportera tilldelningen till kunderna?

N	Fält	Värderapport #3	Värderapport #4	Värderapport #5
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för kund C
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	"INTC"	"INTC"
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:32:27.431Z"

29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"100"	"200"	"300"
33	Pris	"99,33333333333333 "	"99,33333333333333"	"99,33333333333333"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Rapport #3	Rapport #4	Rapport #5
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 ' </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 ' </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 33' </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Granulariteten för datum och tidpunkt för utförandet på marknaden ska kvarstå i rapporterna om tilldelning till kunden, eftersom transaktionen utfördes på handelsplatsen enligt "annan kapacitet".

När värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet" utgör datum och tidpunkt för handel för tilldelningen till kunden datum och tidpunkt för det första utförandet på marknaden i stället för det sista.

5.23.2.3 Värdepappersföretag X handlar med en matchad principal handelskapacitet

Värdepappersföretaget kan inte använda "MTCH" när det utför transaktioner vid olika tidpunkter.

5.23.2.4 Värdepappersföretag X handlar på grundval av en blandad handelskapacitet

Exempel 59

Såsom i exemplet ovan, men värdepappersföretag X utför delar av ordern från sina egna böcker (200 enheter för 100 SEK). Eftersom det ackumulerade kundkontot (INTC) ska vara stängt vid slutet av dagen och företag X tillhandahåller 200 enheter för att delvis utföra order från flera kunder, krävs en rapport för att visa överföringen från företag X:s eget konto till INTC-kontot för att balansera beloppet på marknadssidan och den sida som tilldelas kunderna (rapport #2).

Hur ska värdepappersföretag X rapportera marknadssidan av handeln?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	"INTC"
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:35:30Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"
30	Kvantitet	"400"	"200"
33	Pris	"99"	"100"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </pre>

<pre> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> </Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:35:30Z </TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

Hur ska värdepappersföretag X rapportera tilldelningen till kunderna?

N	Fält	Värderapport #3	Värderapport #4	Värderapport #5
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för kund C
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	"INTC"	"INTC"
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:32:27.431Z"	"2018-09-15T11:32:27.431Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"100"	"200"	"300"
33	Pris	"99,33333333333333"	"99,33333333333333"	"99,33333333333333"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Rapport #3	Rapport #4	Rapport #5
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAA AAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.3333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.3333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.33333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Datum och tidpunkt för handel för tilldelningen till kunderna är datum och tidpunkt för det första utförandet på marknaden. Granulariteten för datum och tidpunkt för utförandet på marknaden ska kvarstå i rapporterna om tilldelning till kunden, eftersom transaktionen utfördes på handelsplatsen enligt "annan kapacitet".

5.23.2.5 Flera transaktioner utförda på olika dagar när värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet"

Exempel 60

Den 24 juli erhåller värdepappersföretag X order om köp av 400 för kund A och 600 för kund B. Ordern utförs i tre delar såsom anges nedan:

200 enheter den 24 juli 2018 klockan 15:33:33 för 100,21 euro (motpart värdepappersföretag Y).

300 enheter den 24 juli 2018 klockan 17:55:55 för 100,52 euro (motpart värdepappersföretag Z).

500 enheter den 25 juli 2018 klockan 13:11:11 för 100,96 euro (motpart företag V med LEI VVVVVVVVVVVVVVVVVVVVV).

Hur ska värdepappersföretag X rapportera handeln på marknadssidan och den vidare tilldelningen?

5.23.2.5.1 Kunderna får ett genomsnittspris

Även om ordern inte har utförts i sin helhet har en tilldelning till kunderna gjorts i slutet av varje dag, eftersom INTC-konton inte kan visa ändringar av positioner för mer än en dag.

Enligt värdepappersföretag X interna förfaranden krävs att kunder behandlas lika, vilket innebär att ingen av dem prioriteras.

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3	Värden Rapport #4
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Z	"INTC"	"INTC"
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-24T15:33:33Z"	"2018-07-24T17:55:55Z"	"2018-07-24T15:33:33Z"	"2018-07-24T15:33:33Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"200"	"300"	"250"	"250"
33	Pris	"100,21"	"100,52"	"100,396"	"100,396"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Report #1	Report #2	Report #3	Report #4
<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>8888888888888 8888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T17:55:55Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB BBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradD t> <TradgCpcty>AOTC< /TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... </New> </Tx>

Vad gäller den transaktion som utfördes den 25 juli 2018:

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2	Värderapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för företag V	"INTC"	"INTC"
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-25T13:11:11Z"	"2018-07-25T13:11:11Z"	"2018-07-25T13:11:11Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"500"	"150"	"350"
33	Pris	"100,96"	"100,96"	"100,96"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVV VVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> </pre>

</Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>
---	---	---

5.23.2.5.2 Princip att order som läggs först utförs först

Enligt företag X:s interna förfaranden ska dess kunder prioriteras i tidsmässigt hänseende vid tilldelningen när det utför ackumulerade transaktioner. Eftersom värdepappersföretag X erhöll ordern från kund A först, får kund A det sammanlagda antalet instrument (400 till ett genomsnittligt pris på 100,365 euro), vilket innebär att dess order fylls i sin helhet. Det återstående antalet är till kund B.

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3	Värden Rapport #4
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Z	"INTC"	"INTC"
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-24T15:33:33Z"	"2018-07-24T17:55:55Z"	"2018-07-24T15:33:33Z"	"2018-07-24T15:33:33Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"200"	"300"	"400"	"100"
33	Pris	"100,21"	"100,52"	"100,365"	"100,52"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Report #1	Report #2	Report #3	Report #4
<Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLM NOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradV n> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>8888888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T17:55:55Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradV n> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.365< /Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456 78901234567890</ ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBBBBB</L EI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 24T15:33:33Z</Tra dDt> <TradgCpcty>AOT C</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.5 2</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</T radVn> </Tx> ...

			</New> </Tx>
--	--	--	-----------------

Vad gäller den transaktion som utfördes den 25 juli 2018 ska den tilldelas kund B och INTC ska inte användas.

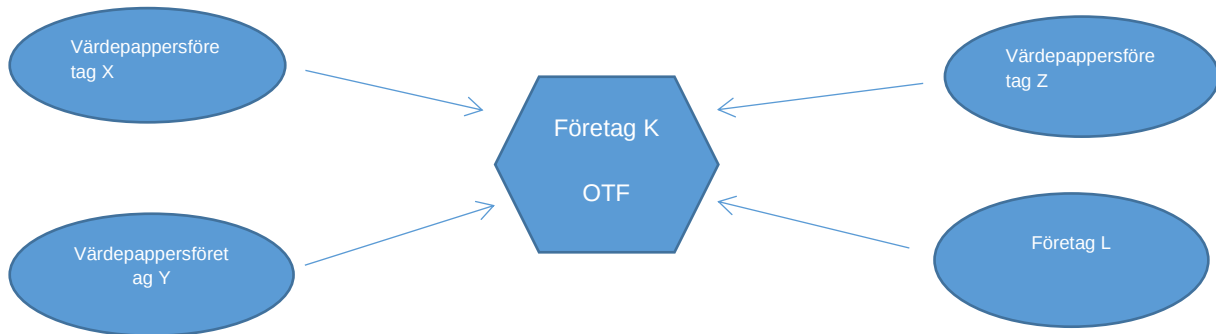
N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVVVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för kund B	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för företag V	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-25T13:11:11Z"	
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
30	Kvantitet	"500"	
33	Pris	"100,96"	
36	Handelsplats	"XOFF"	

5.24 OTF som handlar på grundval av matchad principkapacitet

En OTF som handlar på grundval av matchad principkapacitet handlar på liknande sätt som ett värdepappersföretag och rapporterar på liknande sätt som ett sådant. Alla parter som handlar med denna OTF och nämnda OTF ska rapportera fältet för handelsplatsen som MIC-segmentet för denna

OTF. En OTF som handlar på grundval av matchad principalkapacitet matchar en sidoorder att köpa från en eller flera kunder med en sidoorder att sälja från en eller flera kunder.

Exempel 61



Värdepappersföretag K, en OTF, vars LEI är OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT och MIC-segment OTFX, handlar på grundval av matchad principalkapacitet och dess algoritm med koden "1234ABC", matchar en köporder för statspapper från två värdepappersföretag, företag X och företag Y, med två säljorder från två andra värdepappersföretag, företag Z och företag L. Värdepappersföretag L har en LEI på 77777777777777777777.

Värdepappersföretagen X och Y köper 300 respektive 100 statspapper och värdepappersföretag Z och företag L säljer 150 respektive 250 statspapper.

Värdepappersföretagen X, Y, Z och L handlar alla för egen räkning med avseende på handelskapacitet. Handlare 1 fattade investeringsbeslutet och genomförde det för värdepappersföretag X. Handlare 4 fattade investeringsbeslutet och genomförde det för värdepappersföretag Y. Handlare 5 fattade investeringsbeslutet och genomförde det för värdepappersföretag Z. Handlare 9 fattade investeringsbeslutet och genomförde det för värdepappersföretag L. Handlare 9, Patrick Down, är irländsk medborgare med födelsedatum 14 juli 1960.

Värdepappersföretag K matchar dessa order den 9 juni 2018 klockan 16:41:07.1234Z, till ett pris på 42,7 euro.

Värdepappersföretag Z utför en blankning utan undantag, värdepappersföretag L utför inte någon blankning.

Hur ska värdepappersföretag K (OTF) rapportera?

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3	Värden Rapport #4
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag K	{LEI} för värdepappersföretag K	{LEI} för värdepappersföretag K	{LEI} för värdepappersföretag K
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	"INTC"	"INTC"
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	"INTC"		{LEI} för företag L

				{LEI} för värdepappersfö- retag Z	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06- 09T16:41:07.12 3Z"	"2018-06- 09T16:41:07.123 Z"	"2018-06- 09T16:41:07.123 Z"	"2018-06- 09T16:41:07.12 3Z"
29	Handelskapaci- tet	"MTCH"	"MTCH"	"MTCH"	"MTCH"
30	Kvantitet	"300"	"100"	"150"	"250"
33	Pris	"42,7"	"42,7"	"42,7"	"42,7"
36	Handelsplats	"{MIC}-segment för företag K/OTF"	"{MIC}-segment för företag K/OTF"	"{MIC}-segment för företag K/OTF"	"{MIC}-segment för företag K/OTF"
59	Utförande inom företaget	"1234ABC"	"1234ABC"	"1234ABC"	"1234ABC"
62	Uppgift om blankning			"SESH"	"SELL"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3	Rapport #4
<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOT FOTFOTFOTFOTFOT OT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>777777777777 77777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt>

<pre> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> > </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>MTC H</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> > </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--	---	--

Eftersom mer än en kund är inblandad på varje sida i detta exempel ska det ackumulerade kundkontot INTC användas för att koppla samman köpsidan och säljsidan. Se avsnitt 5.23.

Hur ska kunderna till denna OTF rapportera den handel som utförts?

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3	Värden Rapport #4
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för företag L
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag K	{LEI} för värdepappersföretag K

XML:

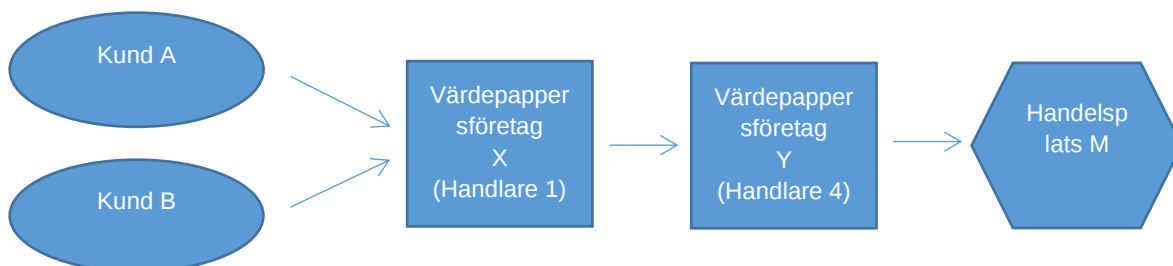
110

09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> <SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
---	---	---	--

5.25 Värdebaserade transaktioner med en balanserande enhet

Detta kan inträffa när värdepappersföretag erbjuder daglig ackumulerad handel som ett kostnadseffektivt alternativ för icke-professionella kunder.

Exempel 62



Två kunder till det spanska värdepappersföretaget X beslutar att köpa samma finansiella instrument, kund A för ett värde på 400 euro och kund B för ett värde på 200 euro. Handlare 1 sänder den ackumulerade ordern med ett värde på 600 euro till värdepappersföretag Y. Handlare 4 utför hela ordern genom en transaktion på handelsplats M den 24 juni 2018 klockan 14:25:30.1264 för fem enheter av instrumentet till ett pris på 120 euro och bekräftar genomförandet för värdepappersföretag X. Värdepappersföretag X tilldelar kund A tre av dessa enheter med ett värde på 360 euro och en enhet till kund B med ett värde på 120 euro. Den balanserande enheten av ett instrument tilldelas genom värdepappersföretag X:s system (ALGOABC) till dess eget konto i syfte att sälja den när så är möjligt. Innehavet kan anses ha ett mer administrativt syfte än vara avsett som en investering i ägandesyfte.

Värdepappersföretag X uppfyller inte villkoren för vidarebefordran av en order enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2	Värderapport #3	Värderapport #4
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B
12	Köparens beslutsfattare				
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	"INTC"	"INTC"	"INTC"
21	Kod för köparens beslutsfattare				
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T14:25:30Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"5"	"1"	"3"	"1"
33	Pris	"120"	"120"	"120"	"120"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

57	Investeringsbeslut inom företaget		"ALGOABC"		
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet				
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 1	"ALGOABC"	{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 1
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"ES"		"ES"	"ES"

XML:

#1 Marknadssidan	Rapport #2 Kundsidan	Rapport #3 Kundsidan	Rapport #4 Kundsidan
<code><Tx></code> <code><New></code> ... <code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> ... <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><Intl>INTC</Intl></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Buyr></code> <code><Sellr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Sellr></code> ... <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt></code>	<code><Tx></code> <code><New></code> ... <code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> ... <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><LEI>12345678901234567890</LEI></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Buyr></code> <code><Sellr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><Intl>INTC</Intl></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Sellr></code> ... <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt></code>	<code><Tx></code> <code><New></code> ... <code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> ... <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Buyr></code> ... <code><Sellr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><Intl>INTC</Intl></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Sellr></code> ... <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt></code>	<code><Tx></code> <code><New></code> ... <code><ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></code> ... <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Buyr></code> <code><Sellr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code> <code><Intl>INTC</Intl></code> <code></Id></code> <code></AcctOwnr></code> <code></Sellr></code> ... <code><Tx></code> <code><TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt></code>

<pre> <TradgCpcty>AOTC </TradgCpcty> <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Pric> </Pric> </Qty> <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</ CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA11122233344 45555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> <Othr> <Prsn> </ExctgPrsn> </Prsn> </Othr> </New> </Tx> </Tx> </Tx> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>DEAL</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> </Pric> </Pric> </Qty> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Algo>ALGOABC</Al go> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Algo>ALGOABC</Al go> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </Tx> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>3</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> </Pric> </Pric> </Qty> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</Ctr yOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> <Othr> <Prsn> </ExctgPrsn> </Prsn> </Othr> </New> </Tx> </Tx> </Tx> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Pric> </Pric> </Qty> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</Ctr yOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> <Othr> <Prsn> </ExctgPrsn> </Prsn> </Othr> </New> </Tx> </Tx> </Tx> </Tx> </pre>
---	---	---	--

Fälten 58 och 60 är tomma i rapport 2, eftersom en algoritm anges i fälten 57 och 59. I rapporterna 1, 3 och 4 är fält 57, investeringsbeslut inom företaget, tomt eftersom värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet". Eftersom ingen filial är involverad ska landskoden för värdepappersföretag X (ES) anges i fält 60.

Samma situation kan uppkomma om ett värdepappersföretag handlar för en kund i enlighet med en diskretionär fullmakt.

I rapporten avseende den balanserande enheten ska en algoritmkod från företaget anges i fält 57, eftersom beslutet fattas av företaget och inte av en fysisk person.

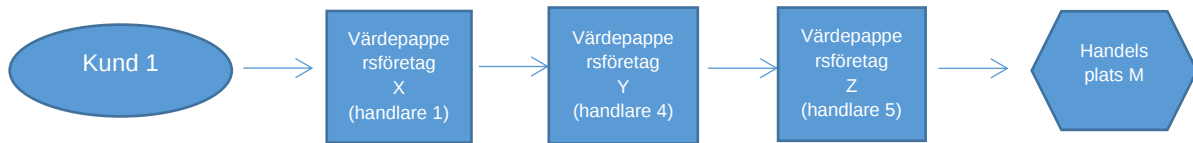
5.26 Kedjor och vidarebefordran

Detta avsnitt omfattar exempel som avser följande:

- a) Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b inte är uppfyllda (underavsnitt **Error! Reference source not found.**).
- b) Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b är uppfyllda men inte alla andra villkor i artikel 4 (underavsnitt 5.26.2).
- c) Kedjor där det sker en vidarebefordran och villkoren som fastställs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är uppfyllda av alla värdepappersföretag (underavsnitt 5.26.3).
- d) Kedjor där villkoren som fastställs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 uppfylls av några värdepappersföretag (underavsnitt 5.26.4).

För en allmän förklaring om kedjor och vidarebefordran, se det relevanta avsnittet i **Error! Reference source not found.** i del I.

Exempel 63



Kund 1, som är kund hos värdepappersföretag X, beslutar att sälja vissa aktier och ger instruktioner till värdepappersföretag X. Handlare 1 beslutar att acceptera ordern från kund 1 och att skicka ordern till värdepappersföretag Y. Handlare 4 beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag X och att skicka ordern till värdepappersföretag Z. Handlare 5 på värdepappersföretag Z beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag Y och algoritmen ALGO12345 från värdepappersföretag Z väljer att skicka ordern till handelsplats M. Ordern fullgörs sedan av värdepappersföretag Z i handelsplats M:s orderbok klockan 13:40:23.4672 den 1 juli 2018 till ett pris av 32,5 euro. Handelsplats M tilldelar transaktionen identifieringskoden "1234".

5.26.1 Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b inte är uppfyllda

Följande exempel visar hur transaktionsrapporter ska fyllas i med avseende på kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b inte är uppfyllda, där varje värdepappersföretag rapporterar sin direkta motpart eller kund, och även hur fälten 25–27 avseende vidarebefordran ska anges i detta scenario. Detta äger rum när ett värdepappersföretag handlar på grundval av matchad principalkapacitet eller med handelskapacitet för egen räkning. För en allmän förklaring av denna typ av kedja hänvisas till underavsnitt 5.3.2 i del I i dessa riktlinjer.

Exempel 64

Värdepappersföretagen Y och Z handlar på grundval av matchad principalkapacitet och värdepappersföretag X handlar för egen räkning.

Hur ska värdepappersföretagen X, Y och Z rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag Z	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #1 värdepappersföretag X	Värderapport #2 värdepappersföretag X
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"			
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X	{NATIONAL_ID} för kund 1	{LEI} för värdepappersföretag X

25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen				
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren				
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-01T13:40:23.467Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"
29	Handelskapacitet	"MTCH"	"MTCH"	"DEAL"	"DEAL"
33	Pris	"32,5"	"32,5"	"32,5"	"32,5"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget			{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 1
59	Utförande inom företaget	"ALGO12345"	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 1

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Z	Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #1 från värdepappersföretag X	Rapport #2 från värdepappersföretag X
<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGH IJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJK LMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</ TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 07- 01T13:40:23.467Z</Tr adDt> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Am t> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</Trad Vn> ... <TradPlcMtgld>123 4</TradPlcMtgld> ... </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</ Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<LEI>1234567890123 4567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</ TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradD t> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Am t> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> ... </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MAR IECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</ Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<Othr> <Id>FR19620604JEAN #COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry > </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</T rnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 07- 01T13:40:23Z</TradDt > <TrnsmssnInd>>false</T rnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 07- 01T13:40:23Z</TradDt > <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Am t> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> ... </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MAR IECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</ Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<LEI>123456789012 34567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</ TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 07- 01T13:40:23Z</Trad Dt> <TradgCpcty>MTCH </TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA11122233344 45555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr>
--	--	---	--

		<pre> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> </Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>CA11122233344 4555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Fält 25: Inget av företagen har vidarebefordrat order eftersom de alla handlar för egen räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet och därför ska alla ange "false" i detta fält.

Fälten 26 och 27: Dessa fält ska enbart fyllas i av ett mottagande värdepappersföretag när villkoren för vidarebefordran är uppfyllda. Eftersom detta inte är fallet ska de inte fyllas i.

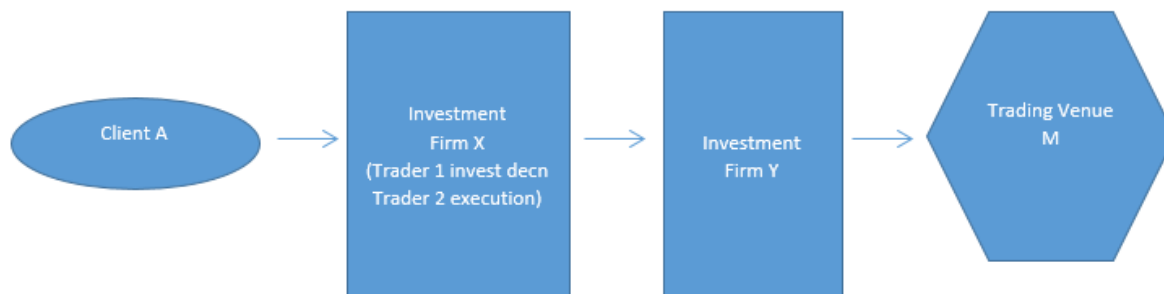
Tidpunkten och priset för varje handelspar i samma transaktion ska överensstämma (dvs. tiden från den transaktion som rapporterats av värdepappersföretag Z med värdepappersföretag Y ska vara samma som den som rapporterats av värdepappersföretag Y med värdepappersföretag Z), med förbehåll för de olika granularitetskraven för företagen – se avsnitt 7.2 om tidsstämpel för granularitet. Enligt fält 28 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 krävs endast att rapporten om marknadssidan på en handelsplats ska rapporteras i enlighet med de krav på granularitet som fastställs i artikel 3 och tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574. Således krävs endast att rapporterna från X och Y är i sekunder (även om de får rapportera med högre granularitet). Värdepappersföretag X kan rapportera den tidpunkt för utförande som värdepappersföretag Y har bekräftat till det. Den tidpunkt och det pris som värdepappersföretag X rapporterar för handeln med kund 1 kan skilja sig från den tidpunkt och det pris som värdepappersföretag X rapporterar för transaktionen med värdepappersföretag Y, eftersom tilldelningen av aktier till kunden kan äga rum vid en annan tidpunkt än transaktionen med motparten på marknaden och kan vara till ett annat pris.

5.26.2 Kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b är uppfyllda men inte alla andra villkor som fastställs i artikel 4

Följande exempel visar att med undantag för fält 25 är rapporteringen av kedjor där villkoren i artikel 4.1 a och b är uppfyllda men inte alla andra villkor som fastställs i artikel 4 huvudsakligen är densamma som för kedjor där inga av villkoren i artikel 4 är uppfyllda.

5.26.2.1 Enkel kedja

Exempel 65



Client A	Kund A
Investment Firm X (Trader 1 invest decn Trader 2 execution)	Värdepappersföretag X (handlare 1 investeringsbeslut handlare 2 utförande)
Investment Firm Y	Värdepappersföretag Y
Trading Venue M	Handelsplats M

Handlare 1 beslutar att köpa ett finansiellt instrument för kund A i enlighet med en diskretionär fullmakt från kund A, och handlare 2 lägger en order till värdepappersföretag Y för att köpa instrumentet. Värdepappersföretag Y, som handlar på grundval av matchad principkapacitet, utför ordern på handelsplats M den 1 juni 2018 klockan 14:51:09.123 till ett pris på 32,5 euro, genom att använda en algoritm med identifieringskoden "ALGO12345".

Handelsplats M tilldelar transaktionen identifieringskoden "1234".

Hur ska värdepappersföretagen Y och X rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag Y	Värderapport värdepappersföretag X
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för kund A
12	Kod för köparens beslutsfattare		{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Y
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"true"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen		
27	Identifieringskod för det		

	vidarebefordrande företaget för säljaren		
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-01T14:51:09.123Z"	"2018-06-01T14:51:09Z"
29	Handelskapacitet	"MTCH"	"AOTC"
33	Pris	"32,5"	"32,5"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget		{NATIONAL_ID} för handlare 1
59	Utförande inom företaget	{Algoritmkod} "ALGO12345"	{NATIONAL_ID} för handlare 2

XML:

Rapport från värdepappersföretag Y	Rapport från värdepappersföretag X
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</Ex ctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 01T14:51:09.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-01T14:51:09Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </pre>

<pre> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchId>1234</TradPlcMtchId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

Värdepappersföretag Y ser inte bortom värdepappersföretag X till investeraren och rapporterar värdepappersföretag X som köpare. Omvänt ser värdepappersföretag X inte bortom värdepappersföretag Y till handelsplatsen och rapporterar handelsplatsen som "XOFF".

I fält 25 ska anges "true" i transaktionsrapporten från värdepappersföretag X, eftersom företaget vidarebefordrar en order även om det inte uppfyller villkoren i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Av samma anledning är fälten 26 och 27 tomma.

Om värdepappersföretag X inte skulle vara ett värdepappersföretag och en vidarebefordran aldrig kan bli tillämplig skulle den behöriga myndigheten endast erhålla rapporten från värdepappersföretag Y.

5.26.2.2 Längre kedja

Exempel 66

Nedanstående exempel grundas på samma scenario som beskrivs i början av avsnitt 5.26, förutom att värdepappersföretagen X, Y och Z handlar enligt "annan kapacitet".

XML:

123

<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmssn Ind> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpc ty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>1234</TradPl cMtchgId> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890< /LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</Trnsmssnl nd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpc ty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</Trnsm ssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Tidpunkten ska vara densamma i alla rapporter, med undantag för de olika granularitetskraven för företagen – se avsnitt 7.2 om tidsstämpel för granularitet. Detta beror på att alla företag handlar enligt "annan kapacitet" vad gäller handelskapacitet och alla rapporter därför är för samma handel. Endast rapporten avseende marknadssidan på en handelsplats ska rapporteras i enlighet med artikel 3 och tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574, och således krävs endast att X och Y rapporterar i sekunder (även om de får rapportera med högre granularitet). Värdepappersföretag Y får rapportera den tidpunkt för utförandet som bekräftats av värdepappersföretag Z, och företag X får rapportera den tidpunkt som bekräftats av värdepappersföretag Y.

Rapporteringen är i princip densamma för en kedja där värdepappersföretagen handlar med matchad principalkapacitet förutom vad gäller fältet avseende uppgift om vidarebefordran av order, i vilket ska

			<pre> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Det krävs inte att värdepappersföretag X ska se bortom sin direkta motpart, vilket innebär att det rapporterar sitt amerikanska dotterbolag, företag G, som säljare.

I fält 59 ska den nationella identifieringskoden för handlare 2 anges, eftersom handlare 2 fattade beslutet att lägga orden hos företag G.

Företag G rapporterar inte, eftersom det inte är ett värdepappersföretag.

5.26.2.3.2 Order som erhålls från ett företag utan rapporteringsskyldighet

Exempel 68

Företag H är en amerikansk fondförvaltare vars LEI är HHHHHHHHHHHHHHHHHHHHHH och som fattar ett investeringsbeslut i enlighet med en diskretionär fullmakt att köpa ett rapporteringspliktigt instrument för dess kund, kund A. Företaget vidarebefordrar ordern till sitt dotterbolag, värdepappersföretag X, för utförande. Handlare 1 som handlar för värdepappersföretag X genomför ordern med värdepappersföretag Z.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag	<pre> <Tx> <New> ... </pre>

		X	
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för företag H	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
12	Kod för köparens beslutsfattare		...
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Z	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>HHHHHHHHHHHHHHHHHHHH</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
21	Kod för köparens beslutsfattare		<Sellr> <AcctOwnr> <Id>
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr>
36	Handelsplats	"XOFF"	</Sellr>
57	Investeringsbeslut inom företaget		<OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn>
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 1	<Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

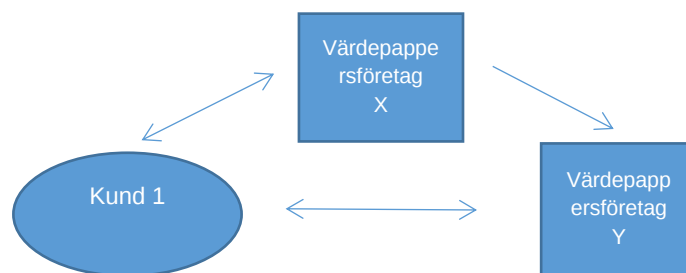
Värdepappersföretag X har inte någon skyldighet att se bortom sin direkta kund och företag H kan inte vidarebefordra i enlighet med villkoren i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 eftersom det inte är ett värdepappersföretag, vilket innebär att värdepappersföretag X ska rapportera det amerikanska dotterbolaget, företag H, som köpare.

Företag H rapporterar inte, eftersom det inte är ett värdepappersföretag.

5.26.2.4 Värdepappersföretag X och dess kund handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt och är båda kunder till det utförande värdepappersföretaget Y

Exempel 69

I avsaknad av en vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, där en fondförvaltningsenhet handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt ska det värdepappersföretag som erhåller ordern rapportera den enhet som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt som köpare/säljare. Detta är fortfarande fallet också om kunden till fondförvaltningsenheten även är kund till det mottagande värdepappersföretaget, och oberoende av huruvida den fondförvaltningsenhet som handlar i enlighet med den diskretionära fullmakten är ett värdepappersföretag eller ett företag.



Kund 1 är kund till värdepappersföretag Y och även kund till värdepappersföretag X.

Värdepappersföretag X har en diskretionär fullmakt från kund 1. Det beslutar att köpa vissa finansiella instrument för kund 1 och skickar en order till värdepappersföretag Y.

Värdepappersföretag X uppfyller inte villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Hur ska värdepappersföretag Y rapportera fältet om köparen/säljaren?

Värdepappersföretag Y ska rapportera värdepappersföretag X som köpare i stället för kund 1.

5.26.3 Kedjor där villkoren som föreskrivs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 uppfylls av alla värdepappersföretag

Endast den information som föreskrivs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 behöver tillhandahållas av det vidarebefordrande värdepappersföretaget och endast i den utsträckning den är relevant för den aktuella ordern. Till exempel, för ett finansiellt instrument som handlas på en organiserad handelsplattform utanför unionen där det underliggande är ett finansiellt instrument som handlas på en handelsplats som inte har någon ISIN ska det vidarebefordrande värdepappersföretaget inte tillhandahålla någon ISIN, eftersom den inte existerar och därför inte är relevant för ordern. Dessutom, även om det vidarebefordrande värdepappersföretaget skulle ha tillhandahållit informationen i fälten 42–56 om det hade rapporterat transaktionen självt, behöver det inte tillhandahålla denna information som en del av de uppgifter som tillhandahålls det mottagande värdepappersföretaget vid

vidarebefordran²⁹. All ytterligare information som det mottagande värdepappersföretaget ska ange i sin transaktionsrapport ska nämnda värdepappersföretag fylla i från sina egna uppgifter mot bakgrund av det faktiska utförandet. Det mottagande värdepappersföretaget ska enbart använda information från det vidarebefordrande värdepappersföretaget för att rapportera de fält som specificeras i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

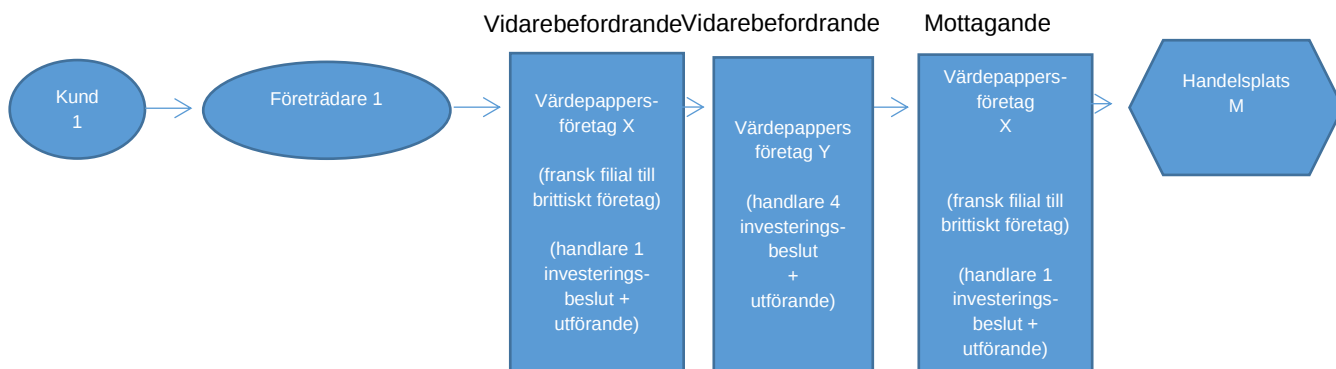
Det pris och den kvantitet som det vidarebefordrande värdepappersföretaget ska tillhandahålla är orderpris och orderkvantitet och det faktiska priset och kvantiteten vid utförandet måste inte bekräftas av det vidarebefordrande värdepappersföretaget, förutom om det är frågan om tilldelningar till mer än en kund, i vilket fall det överförande värdepappersföretaget ska tillhandahålla den kvantitet som ska tilldelas varje kund.

Identifieringen av vem som är den eller de köpare/säljare som ska rapporteras av det mottagande värdepappersföretaget beror enbart på huruvida villkoren för vidarebefordran är uppfyllda. Således, om information om tilldelningen till kunden tillhandahålls vid tidpunkten för ordern, till exempel för clearing och avveckling, men det inte föreligger något avtal om vidarebefordran eller ett av villkoren för vidarebefordran inte är uppfyllt, ska det mottagande företaget rapportera det värdepappersföretag som skickar ordern som köpare/säljare.

Observera att när fält där det vidarebefordrande värdepappersföretaget ska fylla i information (markerade i grönt) är tomma i exemplen nedan beror detta på att det vidarebefordrande värdepappersföretaget har vidarebefordrat dem tomma (vilket innebär att de inte är tillämpliga).

Exemplen nedan visar den information som det vidarebefordrande värdepappersföretaget ska tillhandahålla det mottagande värdepappersföretaget, vilken information det mottagande värdepappersföretaget behöver rapportera från den vidarebefordrade informationen i stället för från sin egen information och hur detta ska anges i dess rapporter. Det visas även att den enhet som ska rapporteras i fältet för identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen/säljaren är den slutliga vidarebefordrande enheten i stället för det vidarebefordrande värdepappersföretag som faktiskt lämnade informationen till det mottagande värdepappersföretaget.

Exempel 70



Kund 1 är en kund till värdepappersföretag X. En person som har befogenhet att företräda kund 1, företrädare 1, beslutar att sälja en kvantitet av 523 råvaruderivat som tillhör kund 1 för minst 31 euro

²⁹ Enligt artikel 4.2 a i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 krävs endast att det finansiella instrumentet kan identifieras genom dess "identifieringskod".

och ger instruktioner till den franska filialen till värdepappersföretag X. Handlare 1, som övervakas av företag X:s brittiska huvudkontor, accepterar ordern från företrädare 1 och ger instruktioner till värdepappersföretag Y. Handlare 4 beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag X och skickar ordern till värdepappersföretag Z. Värdepappersföretag Z är ett brittiskt företag. Handlare 5 beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag Y och handlare 6 skickar ordern till handelsplats M.

Ordern fylls delvis i handelsplats M:s orderbok klockan 13:40:23.4672 den 1 juli 2018 för 500 finansiella instrument till ett pris av 32,50 euro. Handelsplatsen tilldelar transaktionen identifieringskoden "1234".

Råvaruderivatets ISIN är XX000000001.

Kund 1 minskar risken på ett objektivt mätbart sätt i enlighet med artikel 57 i direktiv 2014/65/EU.

Värdepappersföretagen X och Y uppfyller båda kraven för vidarebefordran.

Värdepappersföretag X ska tillhandahålla värdepappersföretag Y följande:

- 1) Det finansiella instrumentets identifieringskod: ISIN för det finansiella instrumentet (XX000000001).
- 2) Det faktum att ordern avser avyttring av det finansiella instrumentet.
- 3) Orderns pris och kvantitet (523 finansiella instrument som inte understiger 31 euro).
- 4) Beteckning på säljaren: nationell identifieringskod för kund 1
- 5) Uppgifter om kund 1:
 - a) Förnamn och efternamn.
 - b) Födelsedatum.
- 6) Beteckning på och uppgifter om beslutsfattaren: nationell identifieringskod för företrädare 1, förnamn, efternamn och födelsedatum för företrädare 1.
- 7) Beteckning för att identifiera den person eller algoritm som är ansvarig för investeringsbeslutet inom det vidarebefordrande företaget (värdepappersföretag X): tom (eftersom investeringsbeslutet fattas utanför företaget – företrädare 1 fattade beslutet).
- 8) Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet: tom
- 9) Land för den filial till värdepappersföretag X som erhöll ordern från kunden: FR
- 10) Uppgift om råvaruderivat: true
- 11) Kod som identifierar det vidarebefordrande värdepappersföretaget: LEI för värdepappersföretag X.

Eftersom värdepappersföretag Y även vidarebefordrar ska det tillhandahålla värdepappersföretag Z samma information som det erhållit från värdepappersföretag X, inbegripet den kod som identifierar det vidarebefordrande värdepappersföretaget, vilket i detta fall är LEI för värdepappersföretag X.

Värdepappersföretag X ska anges i fält 27, eftersom det var värdepappersföretag X som först vidarebefordrade informationen och denna information har överförts till värdepappersföretag Z via värdepappersföretag Y.

För punkterna 1 och 4–10 ovan är informationen exakt densamma som skulle ha rapporterats av värdepappersföretag X om det inte hade uppfyllt villkoren för vidarebefordran och skickat sin egen transaktionsrapport.

I följande exempel ska informationen i fälten som är markerade i grönt fyllas i direkt från den information som tillhandahållits av det överförande värdepappersföretaget, värdepappersföretag Y.

Eftersom både värdepappersföretag X och Y uppfyller villkoren för vidarebefordran ska de inte rapportera transaktionen.

5.26.3.1 Mottagande värdepappersföretag handlar för egen räkning

Rapporten från värdepappersföretag Z ska se ut på följande sätt:

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Z
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Z
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Z	{NATIONAL_ID} för kund 1
17	Land där säljarens filial är belägen		"FR"
18	Säljare – förnamn		"JEAN"
19	Säljare – efternamn		"COCTEAU"
20	Säljare – födelsedatum		1962-06-04
21	Kod för säljarens beslutsfattare		{NATIONAL_ID} för företrädare 1
22	Säljarens beslutsfattare – förnamn		"FABIO"
23	Säljarens beslutsfattare – efternamn		"LUCA"
24	Säljarens beslutsfattare – födelsedatum		"1962-10-11"
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen		
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren		{LEI} för värdepappersföretag X

28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-01T13:40:23.467Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	500	500
33	Pris	"32,5"	"32,5"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	{ISIN} för instrumentet
57	Investeringsbeslut inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 5	
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet	"GB"	
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 6	{NATIONAL_ID} för handlare 6
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"GB"	"GB"
64	Uppgift om råvaruderivat	"false"	"true"

XML:

Rapport #1 marknadssidan	Rapport #2 kundsidan
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> </pre>

<pre> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgid>1234</TradPlcMtchgid> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> ... <RskRdcgTx>>false</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> </pre>
---	---

	<AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
--	--

Fält 57: Eftersom värdepappersföretag Z handlar för egen räkning fattar det investeringsbeslutet och den person som fattar beslutet inom värdepappersföretag Z (handlare 5) ska anges i fält 57 i rapporten avseende marknadssidan. Rapporten avseende kundsidan ska fyllas i på grundval av den information som erhållits från det överförande värdepappersföretaget. I detta exempel ska fältet vara tomt, eftersom detta var den information som erhöles från värdepappersföretag X (eftersom beslutet fattades av företrädare 1).

Fält 58: Även om ordern kommer från en filial har beslutet fattats av kunden (eller dennes företrädare) och därför ska detta fält vara tomt i rapporten avseende kundsidan.

Tidpunkten och priset ska matcha varandra (med förbehåll för de olika granularitetskraven) men tidpunkten i rapporten avseende kundsidan kan vara senare för att reflektera den tidpunkt vid vilken kunden blev ägare. Endast rapporten avseende marknadssidan från värdepappersföretag Z behöver rapporteras med en mikrosekunds granularitet. Rapporten avseende kundsidan behöver endast rapporteras i sekunder (även om värdepappersföretag Z kan rapportera med högre granularitet).

5.26.3.2 Det mottagande företaget handlar med matchad principalkapacitet/enligt "annan kapacitet"

Exempel 71

Om det mottagande värdepappersföretaget, företag Z, handlar med matchad principalkapacitet ska det rapportera på följande sätt:

N	Fält	Värderapport	XML
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm>
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Z	
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
16	Säljarens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för kund 1	
17	Land där säljarens filial är belägen	"FR"	
18	Säljare – förnamn	"JEAN"	
19	Säljare – efternamn	"COCTEAU"	
20	Säljare – födelsedatum	"1962-06-04"	
21	Kod för köparens beslutsfattare	{NATIONAL_ID} för företrädare 1	

22	Säljarens beslutsfattare – förnamn	"FABIO"	<Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn>
23	Säljarens beslutsfattare – efternamn	"LUCA"	
24	Säljarens beslutsfattare – födelsedatum	"1974-10-11"	
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen		
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren	{LEI} för värdepappersför etag X	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-01T13:40:23.467Z"	
29	Handelskapacitet	"MTCH"	
30	Kvantitet	500	
33	Pris	"32,5"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	
57	Investeringsbeslut inom företaget		
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet		
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 6	
64	Uppgift om råvaruderivat	"true"	

			<pre> ... <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Om värdepappersföretag handlar enligt "annan kapacitet" ska transaktionsrapporten vara identisk med rapporten ovan, förutom att handelskapaciteten i fält 29 ska rapporteras som "AOTC".

5.26.3.3 Kunden är skyldig att rapportera transaktionen

Exempel 72

Anta att kund A är ett värdepappersföretag och kund i stället för kund 1. Kund A ska rapportera det pris och den tid som värdepappersföretag X har bekräftat. Värdepappersföretag Z antas handla enligt "annan kapacitet" eller matchad principalkapacitet. Kund A ingår en transaktionsrapport med samma pris och tid som i rapporten från värdepappersföretag Z, med förbehåll för de granularitetskrav som specificeras i avsnitt 7.2, eftersom värdepappersföretagen X, Y och Z alla handlar i annan handelskapacitet och detta därför utgör en enda transaktion. Om värdepappersföretag Z handlar för egen räkning kan priset och tiden skilja sig åt. Kund A ska identifiera värdepappersföretag X som köpare eftersom kund A har handlat med det.

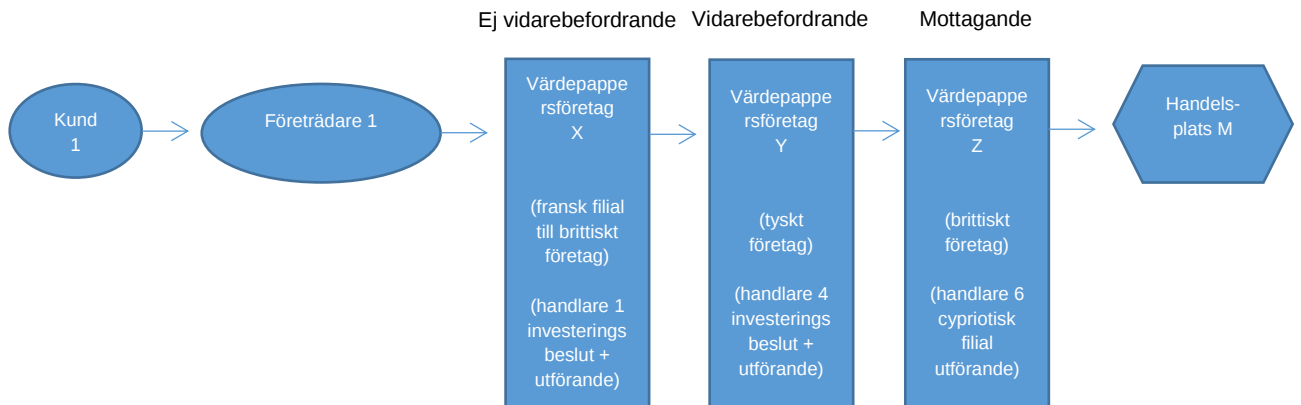
Rapporteringen från värdepappersföretag Z ska vara samma som i exemplen enligt 5.26.3.2 (beroende på dess handelskapacitet), förutom att den ska identifiera kund A med dennes LEI och indikatorn för råvaruderivat ska fyllas i med "false".

5.26.4 Kedjor där de villkor som fastställs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 uppfylls av några värdepappersföretag i kedjan

Exemplet nedan visar att det vidarebefordrande värdepappersföretaget ska ange huruvida det eller en annan part är det ursprungligen vidarebefordrande värdepappersföretaget.

5.26.4.1 Värdepappersföretag som handlar med slutkunden och inte uppfyller villkoren för vidarebefordran

Exempel 73



Kund 1 är kund till värdepappersföretag X. En person som har befogenhet att företräda kund 1, företrädare 1, beslutar att sälja vissa aktier från kund 1 och ger instruktioner till den franska filialen till värdepappersföretag X. Handlare 1, som övervakas av det brittiska huvudkontoret, beslutar att acceptera ordern från kund 1 och att skicka den till värdepappersföretag Y, ett tyskt företag. Handlare 4 beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag Y och skickar den till värdepappersföretag Z. Handlare 5 beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag Y och handlare 6, som övervakas av den cypriotiska filialen till värdepappersföretag Z, skickar ordern till handelsplats M. Värdepappersföretagen X och Y handlar enligt "annan kapacitet" avseende handelskapacitet, medan värdepappersföretag Z handlar med handelskapacitet för egen räkning.

Ordern fullgörs i handelsplats M:s orderbok genom värdepappersföretag Z klockan 13:40:23.4672 den 1 juli 2018 till ett pris av 32,50 euro. Handelsplatsen tilldelar transaktionen identifieringskoden "1234". Värdepappersföretag X väljer att inte vidarebefordra uppgifterna till värdepappersföretag Y.

Värdepappersföretag Y vidarebefordrar uppgifterna om kunden (värdepappersföretag X) och annan information som krävs till värdepappersföretag Z och uppfyller de andra villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Värdepappersföretag Y är ett tyskt företag.

Kund 1 utför en blankning.

Transaktionen gäller en aktie med ISIN XX000000002.

Värdepappersföretag Y ska tillhandahålla värdepappersföretag Z följande:

- 1) Det finansiella instrumentets identifieringskod: ISIN för instrumentet XX000000002.
- 2) Det faktum att ordern avser avyttring av det finansiella instrumentet.
- 3) Orderns pris och kvantitet.
- 4) Beteckning på säljaren: LEI för värdepappersföretag X. Detta beror på att värdepappersföretag X inte har vidarebefordrat uppgifterna om sin kund (kund 1) till värdepappersföretag Y. Därför betraktar värdepappersföretag Y värdepappersföretag X som köpare i stället för kund 1.

- 5) Beteckning på och uppgifter om beslutsfattaren: tom
- 6) Uppgift om blankning: SELL (värdepappersföretag X utför ingen blankning).
- 7) Beteckning för att identifiera en person eller algoritm som är ansvarig för investeringsbeslutet inom det vidarebefordrande företaget (som ett beslut som fattas utanför företaget).
- 8) Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet: tom (eftersom beslutet fattas utanför värdepappersföretag Y)
- 9) Land för den filial till värdepappersföretag Y som erhöll ordern från kunden: DE (eftersom ingen filial har varit inblandad anges här landskoden på två bokstäver för företagets huvudkontor; i detta fall är det ett tyskt företag, vilket innebär att "DE" ska anges i detta fält)
- 10) Kod som identifierar det vidarebefordrande värdepappersföretaget: LEI för värdepappersföretag Y.

Eftersom värdepappersföretag X inte uppfyller kraven för vidarebefordran ska det skicka sin egen transaktionsrapport.

Eftersom värdepappersföretag Y uppfyller kraven för vidarebefordran ska det inte skicka någon transaktionsrapport.

Hur ska värdepappersföretagen X och Z rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 från värdepappersföreta g Z	Värderapport #2 från värdepappersföreta g Z	Värderapport #1 från värdepappersföreta g X
3	Handelsplatsens identifieringskod	"1234"		
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Y
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag X	{NATIONAL_ID} för kund 1
17	Land där säljarens filial är belägen		"DE"	"FR"
18	Säljare – förnamn			"JEAN"
19	Säljare – efternamn			"COCTEAU"
20	Säljare – födelsedatum			"1962-06-04"
21	Kod för köparens beslutsfattare			{NATIONAL_ID} för företrädare 1

22	Säljarens beslutsfattare – förnamn			"FABIO"
23	Säljarens beslutsfattare – efternamn			"LUCA"
24	Säljarens beslutsfattare – födelsedatum			"1974-10-11"
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"true"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen			
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren		{LEI} för värdepappersföretag Y	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-07-01T13:40:23.467Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"	"2018-07-01T13:40:23Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"AOTC"
33	Pris	"32,5"	"32,5"	"32,5"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	XOFF	XOFF
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	{ISIN} för instrumentet	{ISIN} för instrumentet
57	Investeringsbeslut inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 5		
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet	"GB"		
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 6	{NATIONAL_ID} för handlare 6	{NATIONAL_ID} för handlare 1
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"CY"	"CY"	"GB"
62	Uppgift om blankning	"SELL"	"SELL"	"SESH"

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Z Marknadssidan	Rapport #2 från värdepappersföretag Z Kundsidan	Rapport #1 från värdepappersföretag X
<Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888 888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 8</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPlcMtgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm>	<Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn>

<Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> ... <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> <Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
--	--	---

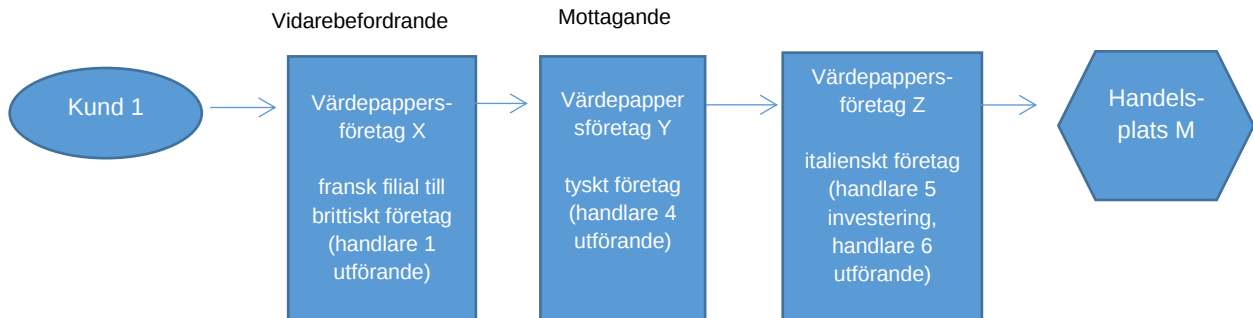
Identifieringskoden för det vidarebefordrande företaget för säljaren (fält 27) för säljaren i transaktionsrapporterna från värdepappersföretag Z är värdepappersföretag Y och inte värdepappersföretag X (eftersom värdepappersföretag X inte har vidarebefordrat), på grund av att värdepappersföretag Y har uppgett för värdepappersföretag Z att det självt vidarebefordrade den order det skickade till värdepappersföretag Z för värdepappersföretag X:s räkning.

Fälten 57 och 58 i rapport 2 (rapporten avseende kundsidan) ska fyllas i med den information som tillhandahålls av värdepappersföretag Y till värdepappersföretag Z, vilket rapporterar. Båda fälten är tomma, eftersom beslutet fattades av kunden. Således ska värdepappersföretag Z fylla i sin egen information i fälten 59 och 60 och således ska handlare 6, som övervakas av den cypriotiska filialen till värdepappersföretag Z, anges³⁰.

5.26.4.2 Värdepappersföretag som handlar både som mottagande och vidarebefordrande företag utan att uppfylla villkoren för vidarebefordran

³⁰ Observera dock att om kunden fattade beslutet ska "NORE" anges (se avsnitt 5.12).

Exempel 74



Kund 1 är kund till värdepappersföretag X. Handlare 1, som är placerad vid värdepappersföretag X:s franska filial, handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt från kund 1 och ger värdepappersföretag Y, ett tyskt företag, en order om försäljning av finansiella instrument. Handlare 1 övervakas av det brittiska huvudkontoret till värdepappersföretag X. Handlare 4 beslutar att acceptera en order från företag X och att skicka ordern till företag Z. Handlare 5, som handlar för värdepappersföretag Z, ett italienskt företag, beslutar att acceptera ordern från värdepappersföretag Y och handlare 6 skickar ordern till handelsplats M.

Ordern slutförs sedan av värdepappersföretag Z i handelsplats M:s orderbok klockan 13:40:23.4672 den 1 juli 2018 till ett pris av 32,50 euro. Handelsplatsen tilldelar transaktionen identifieringskoden "1234".

Värdepappersföretag X vidarebefordrar uppgifterna om kund 1 och annan information till värdepappersföretag Y såsom ovan och uppfyller de övriga villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Värdepappersföretag Y väljer att vidarebefordra uppgifterna till värdepappersföretag Z. Värdepappersföretag Z handlar för egen räkning med avseende på handelskapaciteten.

Transaktionen avser ett råvaruderivat med ISIN XX000000003 och kund 1 minskar inte sin risk på ett objektivet mätbart sätt i enlighet med artikel 57 i direktiv 2014/65/EU.

Värdepappersföretag X ska tillhandahålla värdepappersföretag Y följande:

- 1) Instrumentets identifieringskod: ISIN för instrumentet (XX000000003).
- 2) Det faktum att ordern avser avyttring av det finansiella instrumentet.
- 3) Orderns pris och kvantitet.
- 4) Beteckning på säljaren: nationell identifieringskod för kund 1.
- 5) Uppgifter om kund 1:
 - a) Förnamn och efternamn.
 - b) Födelsedatum.
- 6) Beteckning på och uppgifter om beslutsfattaren: LEI för värdepappersföretag X.
- 7) Beteckning för att identifiera en person eller algoritm som är ansvarig för investeringsbeslutet inom det vidarebefordrande värdepappersföretaget (värdepappersföretag X): {NATIONAL_ID} för handlare 1
- 8) Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet: GB
- 9) Land för den filial till värdepappersföretag X som erhöll ordern från kunden: FR
- 10) Kod som identifierar det vidarebefordrande företaget: LEI för värdepappersföretag X.

11) Uppgift om råvaruderivat: falsk

Eftersom värdepappersföretag Y inte vidarebefordrar alla uppgifter ska det skicka sin egen transaktionsrapport.

Eftersom värdepappersföretag X uppfyller alla villkor för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska det inte rapportera transaktionen.

N	Fält	Värderapport #1 från värdepappersföretag Z	Värderapport #2 från värdepappersföretag Z	Värderapport #1 från värdepappersföretag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"		
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Z
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Z	{LEI} för värdepappersföretag Y	{NATIONAL_ID} för kund 1
17	Land där säljarens filial är belägen		"IT"	"FR"
18	Säljare – förnamn			"JEAN"
19	Säljare – efternamn			"COCTEAU"
20	Säljare – födelsedatum			"1962-06-04"
21	Kod för köparens beslutsfattare			{LEI} för värdepappersföretag X
22	Säljarens beslutsfattare – förnamn			
23	Säljarens beslutsfattare – efternamn			
24	Säljarens beslutsfattare – födelsedatum			
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"true"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen			

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Z Marknadssidan	Rapport #2 från värdepappersföretag Z Kundsidan	Rapport #1 från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> </pre>

<AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPlcMtgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX0000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr>	<AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN QRST</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX0000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr>	<AcctOwnr> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX0000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn>
--	--	--

<pre> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>CA1112223334445555</I d> </Othr> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Värdepappersföretag Y handlar både som mottagande värdepappersföretag (erhåller information från värdepappersföretag X där villkoren för vidarebefordran är uppfyllda) och som vidarebefordrande värdepappersföretag som inte uppfyller villkoren för vidarebefordran. Som sådant har värdepappersföretag Y en skyldighet att rapportera transaktionen. Värdepappersföretag Y ska fylla i fält 25 för att visa att det vidarebefordrar utan att uppfylla villkoren för vidarebefordran, och fält 27 för att visa att det har erhållit information från värdepappersföretag X som har uppfyllt villkoren för vidarebefordran till värdepappersföretag Y. Vidare ska den information som erhållits av värdepappersföretag X anges i fält 17 och därför ska filialen till det vidarebefordrande värdepappersföretaget anges i stället för filialen till det mottagande värdepappersföretaget.

5.26.4.3 Företag som ackumulerar order och uppfyller villkoren för vidarebefordran för vissa order men inte för andra

Exempel 75

Två kunder till värdepappersföretag X, kunderna A och B, lägger säljorder för 100 respektive 200 instrument.

Värdepappersföretag X vidarebefordrar dessa order till värdepappersföretag Y. Värdepappersföretag X uppfyller endast villkoren för vidarebefordran i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 för ordern från kund A. Värdepappersföretag Y utför den ackumulerade ordern på 300 för 25,54 euro den 28 oktober 2018 klockan 11:23:45.1243 på handelsplats M. Värdepappersföretag X och företag Y handlar enligt "annan kapacitet".

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för kund B	
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"true"	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-10-28T11:23:45Z"	
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
30	Kvantitet	"200"	
33	Pris	"25,54"	
36	Handelsplats	"XOFF"	

Hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2	Värderapport #3
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	"INTC"	"INTC"
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för värdepappersföretag X
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen			
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren		{LEI} för värdepappersföretag X	
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-10-28T11:23:45.124Z"	"2018-10-28T11:23:45.124Z"	"2018-10-28T11:23:45.124Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"300"	"100"	"200"
33	Pris	"25,54"	"25,54"	"25,54"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"

XML:

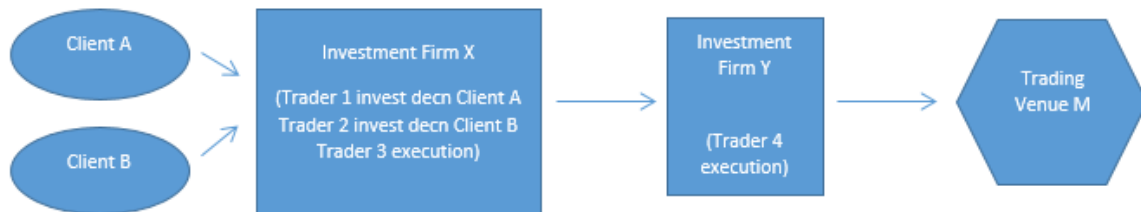
Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </pre>

<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </pre>
---	--	---

5.27 Värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder

5.27.1 Värdepappersföretag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder utan att uppfylla villkoren för vidarebefordran (kombination av ackumulerade order och kedjor/vidarebefordran)

Exempel 76



Client A	Kund A
Client B	Kund B
Investment Firm X	Värdepappersföretag X
(Trader 1 invest decn Client A Trader 1 invest decn Client B Trader 3 execution)	(handlare 1 investeringsbeslut kund A handlare 1 investeringsbeslut kund B handlare 3 utförande)
Investment Firm Y	Värdepappersföretag Y
(Trader 3 execution)	(handlare 3 utförande)
Trading Venue M	Handelsplats M

Värdepappersföretag X handlar för kund A och kund B i enlighet med diskretionära fullmakter. Handlare 1 beslutar att köpa 400 enheter av ett visst finansiellt instrument för kund A. Handlare 2 beslutar att köpa 200 enheter av samma finansiella instrument för kund B. Handlare 3 skickar den ackumulerade ordern till värdepappersföretag Y för utförande. Ordern utförs sedan i två omgångar av handlare 4 på handelsplats M, den ena den 24 juni 2018 klockan 14:25:30.1264 för 350 instrument för 30 euro och den andra den 24 juni 2018 klockan 15:55:40.3452 för 250 instrument för 32,5 euro. Handelsplatsen tillhandahåller identifieringskoderna "1234" och "6789" för de respektive transaktionerna.

Om värdepappersföretag X är en förvaltningsbolag som förvaltar en fond och inte ett värdepappersföretag ska värdepappersföretag Y identifiera förvaltningsbolaget som köpare/säljare och fälten för beslutsfattare ska inte fyllas i, eftersom förvaltningsbolaget inte är ett värdepappersföretag, inte är rapporteringsskyldig och inte kan vidarebefordra.

Hur värdepappersföretag X rapporterar beror på hur värdepappersföretag Y bekräftar utförandet till värdepappersföretag X såsom illustreras nedan.

På ett liknande sätt är det sätt på vilket kund A och kund B skulle rapportera om de vore värdepappersföretag beroende av hur värdepappersföretag X bekräftar utförandet till dem.

Värdepappersföretag X uppfyller inte villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Värdepappersföretag X handlar enligt "annan kapacitet" vad gäller handelskapacitet.

5.27.1.1 Värdepappersföretag Y bekräftar alla utföranden på marknadssidan till värdepappersföretag X

Detta ska göras när den utförande mäklaren handlar enligt en "annan kapacitet" eller matchad principal handelskapacitet.

Värdepappersföretag Y handlar enligt "annan kapacitet" vad gäller handelskapacitet.

Exempel 77

Scenario såsom anges i exemplet i 5.27.1 där den utförande mäklaren Y bekräftar varje utförande på marknaden till värdepappersföretag X.

Värdepappersföretag X ska rapportera eftersom det inte uppfyller villkoren för vidarebefordran.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värde- rapport #1 värdepap persföret ag X	Värde- rapport #2 värdepap persföret ag X	Värde- rapport #3 värdepap persföret ag X	Värde- rapport #4 värdepap persföret ag X	Värde- rapport #1 värdepap persföret ag Y	Värde- rapport #2 värdepap persföret ag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner					"1234"	"6789"
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag Y	{LEI} för värdepap persföret ag Y
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag X
12	Kod för köparens beslutsfattare			{LEI} för värdepap persföret ag X	{LEI} för värdepap persföret ag X		
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepap persföret ag Y	{LEI} för värdepap persföret ag Y	"INTC"	"INTC"	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M
21	Kod för köparens beslutsfattare						

25	Uppgift om vidarebefordran av order	"true"	"true"	"true"	"true"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrade företaget för köparen						
27	Identifieringskod för det vidarebefordrade företaget för säljaren						
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T15:55:40Z"	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T14:25:30Z"	"2018-06-24T14:25:30.126Z"	"2018-06-24T15:55:40.345Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"350"	"250"	"400"	"200"	350	250
33	Pris	"30"	"32,5"	"31,0416667"	"31,0416667"	30	32,5
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"	EUR	EUR
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M
57	Investeringsbeslut inom företaget			{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 2		
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4

Observera att i rapporterna 3 och 4 från värdepappersföretag X anges värdepappersföretag X i fält 12, eftersom värdepappersföretag X handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för kunderna A och B. Identiteten på de handlare som fattade beslutet för kunderna A och B ska anges i fält 57.

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag X	Rapport #2 från värdepappersföretag X	Rapport #3 från värdepappersföretag X	Rapport #4 från värdepappersföretag X
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:40Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>

<code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code><ExctgPrsn></code> <code><Prsn></code> <code>...</code> <code><Othr></code> <code><Id>BE12345678901</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>NIDN</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></ExctgPrsn></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>	<code></Pric></code> <code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code><ExctgPrsn></code> <code><Prsn></code> <code>...</code> <code><Othr></code> <code><Id>BE12345678901</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>NIDN</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></ExctgPrsn></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>	<code><Amt</code> <code>Ccy="EUR">31.041667</Amt></code> <code></MntryVal></code> <code></Pric></code> <code></Pric></code> <code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code><InvstmtDcsnPrsn></code> <code><Prsn></code> <code>...</code> <code><Othr></code> <code><Id>CA1112223334445555</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>CCPT</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></InvstmtDcsnPrsn></code> <code><ExctgPrsn></code> <code><Prsn></code> <code><Othr></code> <code><Id>BE12345678901</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>NIDN</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></ExctgPrsn></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>	<code><Amt</code> <code>Ccy="EUR">31.0416667</Amt></code> <code></MntryVal></code> <code></Pric></code> <code></Pric></code> <code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code><InvstmtDcsnPrsn></code> <code><Prsn></code> <code>...</code> <code><Othr></code> <code><Id>GBAB123456C</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>NIDN</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></InvstmtDcsnPrsn></code> <code><ExctgPrsn></code> <code><Prsn></code> <code>...</code> <code><Othr></code> <code><Id>BE12345678901</Id></code> <code><SchmeNm></code> <code><Cd>NIDN</Cd></code> <code></SchmeNm></code> <code></Othr></code> <code></Prsn></code> <code></ExctgPrsn></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>
--	--	---	---

Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #2 från värdepappersföretag Y
<code><Tx></code> <code><New></code> <code>...</code> <code><ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty></code> <code>...</code> <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code>	<code><Tx></code> <code><New></code> <code>...</code> <code><ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty></code> <code>...</code> <code><Buyr></code> <code><AcctOwnr></code> <code><Id></code>

<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30.126Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>6789</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Värdepappersföretag X ska rapportera marknadssidan från transaktionen med värdepappersföretag Y, utöver tilldelningarna till kunderna.

Värdepappersföretag X rapporterar var och en av transaktionerna som värdepappersföretag Y har bekräftat in till det ackumulerade kundkontot INTC och rapporterar sedan överföringen ut från det ackumulerade kontot till kunderna.

Om värdepappersföretag Y handlar med matchad principal handelskapacitet ska rapporteringen vara densamma, förutom att handelskapaciteten i fält 29 i rapporten från värdepappersföretag Y ska vara "MTCH".

5.27.1.2 Värdepappersföretag Y bekräftar den utförda transaktionen till värdepappersföretag X

Detta ska göras när den utförande mäklaren Y handlar för egen räkning med avseende på handelskapaciteten.

Exempel 78

Scenariot är detsamma som i exemplet i 5.27.1 ovan, bortsett från att värdepappersföretag Y bekräftar den utförda transaktionen till värdepappersföretag X i stället för de individuella utförandena på marknaden. Tiden ska motsvara det andra utförandet eller senare för att spegla tidpunkten för tilldelningen till värdepappersföretag Y. Exempelvis bekräftar Y till värdepappersföretag X att det har köpt 600 aktier till ett pris av 31,0416667 den 24 juni 2018 klockan 16:06:20.34.

Värdepappersföretag X ska rapportera eftersom det inte uppfyller villkoren för vidarebefordran.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värde- rapport #1 värdepap persföreta g X	Värde- rapport #2 värdepap persföreta g X	Värde- rapport #3 värdepap persföreta g X	Värde- rapport #1 värdepap persföreta g Y	Värde- rapport #2 värdepap persföreta g Y	Värde- rapport #3 värdepap ersföretag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner				"1234"	"6789"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepap persföreta g X	{LEI} för värdepap persföreta g X	{LEI} för värdepap persföreta g X	{LEI} för värdepap persföreta g Y	{LEI} för värdepap persföreta g Y	{LEI} för värdepap ersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för värdepap persföreta g Y	{LEI} för värdepap persföreta g Y	{LEI} för värdepap ersföretag X
12	Kod för köparens beslutsfattare		{LEI} för värdepap persföreta g X	{LEI} för värdepap persföreta g X			
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepap persföreta g	"INTC"	"INTC"	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepap ersföretag Y

		Y					
21	Kod för köparens beslutsfattare						
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"true"	"true"	"true"	"false"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen						
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren						
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T16:06:20Z"	"2018-06-24T16:06:20Z"	"2018-06-24T16:06:20Z"	"2018-06-24T14:25:30.126Z"	"2018-06-24T15:55:40.345Z"	"2018-06-24T16:06:20Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	"600"	"400"	"200"	"350"	"250"	"600"
33	Pris	"31,0416667"	"31,0416667"	"31,0416667"	"30"	"32,5"	"31,0416667"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"	{MIC}-segment för handelsplats M	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget		{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 2	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 3	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag X	Rapport #2 från värdepappersföretag X	Rapport #3 från värdepappersföretag X
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn>	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> >	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>123456789012345678900</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> </Id>
--	--	--

</ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
--	---	---

Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #2 från värdepappersföretag Y	Rapport #3 från värdepappersföretag Y
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOP QRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>

<pre> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:30.126.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPl cMtgId> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>6789</TradPl cMtgId> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

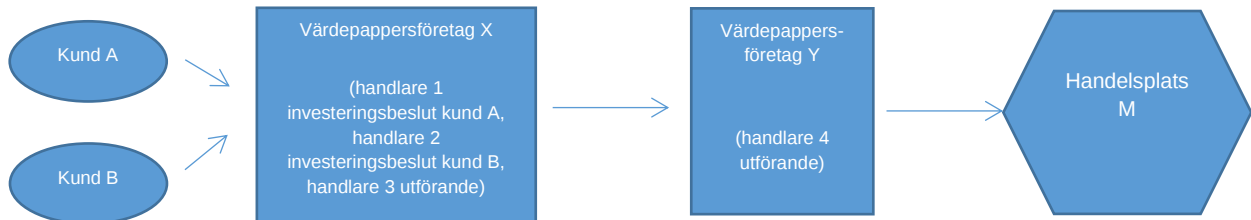
Såsom anges ovan ska värdepappersföretag X rapportera marknadssidan av transaktionen med värdepappersföretag Y utöver tilldelningarna till kunderna.

Eftersom värdepappersföretag Y handlar för egen räkning bekräftar det utförda ackumulerade beloppet till företag X, vilket innebär att värdepappersföretag X rapporterar en transaktion för det ackumulerade beloppet in till det ackumulerade kundkontot INTC och sedan rapporterar rörelsen ut från detta konto till kunderna.

Om värdepappersföretag X ackumulerar order och endast uppfyller villkoren för vidarebefordran för vissa order men inte för andra, se avsnitt 5.26.4.3.

5.27.2 Fondförvaltare som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för flera kunder och uppfyller villkoren för vidarebefordran

Exempel 79



Handlare 1, som övervakas av värdepappersföretag X, ett företag som handlar i enlighet med en diskretionär fullmakt för kunderna 1 och 2 och beslutar att sälja 500 aktier för kund 1, och handlare 2, som övervakas av värdepappersföretag X, beslutar att sälja 200 aktier för kund 2. Handlare 3, som övervakas av värdepappersföretag X, skickar den ackumulerade ordern på 700 aktier till värdepappersföretag Y. Handlare 4, som övervakas av värdepappersföretag Y, accepterar ordern och utför den på handelsplats M genom en enda transaktion den 24 juni 2018 klockan 13:20:52.1456 till ett pris av 21 euro.

Värdepappersföretag X är ett brittiskt företag och värdepappersföretag Y är ett italienskt företag.

Kund 1 utför en blankning, men inte kund 2. Värdepappersföretag Y:s positioner var stängda före försäljningen på marknaden och således genomför det en blankning vid tidpunkten för utförandet på marknaden.

Värdepappersföretag X vidarebefordrar uppgifterna om kund 1 och kund 2 samt annan information till värdepappersföretag Y såsom nedan och uppfyller de andra villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590.

Värdepappersföretag X ska tillhandahålla värdepappersföretag Y följande:

- 1) Det finansiella instrumentets identifieringskod: ISIN för instrumentet.
- 2) Det faktum att ordern avser avyttring av det finansiella instrumentet.
- 3) Orderns pris och kvantitet: marknadspris för 700 aktier.
- 4) Beteckning på och uppgifter om beslutsfattaren: LEI för värdepappersföretag X.
- 5) Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet: GB
- 6) Land för den filial till värdepappersföretag X som fattade investeringsbeslutet: GB
- 7) Kod som identifierar det vidarebefordrande företaget: LEI för värdepappersföretag X.

Värdepappersföretag X tillhandahåller därefter följande (efter utförandet men inom den tid som är tillåten enligt avtalet om vidarebefordran):

- 8) Tilldelningen till kund 1 och kund 2.
- 9) Beteckning på säljarna: nationell identifieringskod för kund 1 och nationell identifieringskod för kund 2.
- 10) Uppgifter om kund 1:
 - a) Förnamn och efternamn.
 - b) Födelsedatum.
- 11) Uppgift om blankning för kund 1: SESH (kund 1 utför en blankning).
- 12) Beteckning för att identifiera en person eller algoritm som är ansvarig för investeringsbeslutet inom företaget för kund 1: {NATIONAL_ID} för handlare 1
- 13) Uppgifter om kund 2:
 - a) Förnamn och efternamn.
 - b) Födelsedatum.
- 14) Uppgift om blankning för kund 2: SELL (kund 2 utför inte någon blankning).
- 15) Beteckning för att identifiera en person eller algoritm som är ansvarig för investeringsbeslutet inom företaget för kund 2: {NATIONAL_ID} för handlare 2

Värdepappersföretag Y handlar för egen räkning och överför värdepappren till värdepappersföretag X klockan 15:00:12:51 samma dag.

Hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #2 värdepappersföretag Y	Värderapport #3 värdepappersföretag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"		
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
12	Kod för köparens beslutsfattare			
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{NATIONAL_ID} för kund 1	{NATIONAL_ID} för kund 2
18	Säljare – förnamn		"JEAN"	"JOSE, LUIS"

19	Säljare – efternamn		"COCTEAU"	"RODRIGUEZ DE LA TORRE"
20	Säljare – födelsedatum		"1962-06-04"	"1976-02-27"
21	Kod för köparens beslutsfattare		{LEI} för företag X	{LEI} för företag X
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen			
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren		{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T13:20:52.1456Z"	"2018-06-24T15:00:12Z"	"2018-06-24T15:00:12Z"
29	Handelskapacitet	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
30	Kvantitet	700	500	200
33	Pris	21	21	21
34	Prisvaluta	EUR	EUR	EUR
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 2
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet	"IT"	"GB"	"GB"
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"IT"	"IT"	"IT"
62	Uppgift om blankning	"SESH"	"SESH"	"SELL"

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #2 från värdepappersföretag Y	Rapport #3 från värdepappersföretag Y
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...

<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglId>1234</TradPl cMtchglId> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr>	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06- 04BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCT E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> <TrnsmttgSellr>123456789012 34567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty>	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ QRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02- 27-</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> <TrnsmttgSellr>12345678901 234567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty>
--	--	---

<pre> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id > <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBr nch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAI R</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSel lgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	--	--

Om värdepappersföretag Y i stället handlar enligt "annan kapacitet" vad gäller handelskapacitet, hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #2 värdepappersföretag Y	Värderapport #3 värdepappersföretag Y
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"		
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	"INTC"	"INTC"
12	Kod för köparens beslutsfattare			
16	Säljarens identifieringskod	"INTC"	{NATIONAL_ID} för kund 1	{NATIONAL_ID} för kund 2
18	Säljare – förnamn		"JEAN"	"JOSE, LUIS"
19	Säljare – efternamn		"COCTEAU"	"RODRIGUEZ DE LA TORRE"
20	Säljare – födelsedatum		"1962-06-04"	"1976-02-27"
21	Kod för köparens beslutsfattare		{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"	"false"
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen			
27	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för säljaren		{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
28	Datum och tidpunkt för handel	"2018-06-24T13:20:52.1456Z"	"2018-06-24T13:20:52.1456Z"	"2018-06-24T13:20:52.1456Z"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
30	Kvantitet	"700"	"500"	"200"
33	Pris	"21"	"21"	"21"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"

57	Investeringsbeslut inom företaget		{NATIONAL_ID} för handlare 1	{NATIONAL_ID} för handlare 2
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet		"GB"	"GB"
59	Utförande inom företaget	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4	{NATIONAL_ID} för handlare 4
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet	"IT"	"IT"	"IT"
62	Uppgift om blankning		"SESH"	"SELL"

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #2 från värdepappersföretag Y	Rapport #3 från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </pre>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPlcMtgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>..</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn>	</Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ...
--	--	---

	<pre> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSell gInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Om värdepappersföretag Y handlar med matchad handelskapacitet ska rapporten vara identisk med den ovan, förutom att "MTCH" ska anges som handelskapacitet.

5.28 Direkt elektroniskt tillträde(DEA)

Både den som tillhandahåller DEA och kunden, om den är ett värdepappersföretag, ska inge en transaktionsrapport (med förbehåll för det undantag som anges i alternativ B).

Vid transaktionsrapporteringen ska DEA-leverantören säkerställa att denne identifierar sig som utförande enhet (fält 4 "Identifieringskod för den utförande enheten"). Eftersom DEA-användaren (kunden) tar beslut om utförandet ska DEA-leverantören fylla i fältet för utförande inom företaget med "NORE", vilket framgår av 5.12. DEA-leverantören ska aldrig fylla i fält 57 ("Investeringsbeslut inom företaget"), eftersom den aldrig är inblandad i investeringsbeslutet, för vilket kunden ansvarar. Dessutom ska DEA-leverantören rapportera handelskapaciteten AOTC eller MTCH (fält 29).

I sin transaktionsrapport ska kunden identifiera DEA-leverantören snarare än marknaden som antingen köpare (fält 7 – "Köparens identifieringskod" eller säljare (fält 16 – "Säljarens identifieringskod"). Dessutom ska kunden alltid fylla i fält 36 ("Handelsplats") med "XOFF" eftersom den inte är den enhet som är riktad mot marknaden. Det ska emellertid framhållas att om DEA-kunden handlar för en kunds räkning och denne har vidarebefordrat uppgifterna från denna kund i enlighet med villkoren som föreskrivs i artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, ska DEA-kunden inte rapportera transaktionen, eftersom all relevant information om transaktionen kommer att tillhandahållas den behöriga myndigheten genom transaktionsrapporten från DEA-leverantören.

5.28.1 Scenario 1: DEA-kunden handlar för egen räkning utan någon underliggande kund

Exempel 80

Värdepappersföretag X (DEA-kund) använder medlemskoden från värdepappersföretag Y (DEA-leverantör) för att inge en order till handelsplats M. Ordern från värdepappersföretag X avser köp av

finansiella instrument på handelsplats M. Inom värdepappersföretag X har handlare 1 fattat investeringsbeslutet, medan handlare 2 är ansvarig för ingivandet av ordern för utförande genom den DEA-mekanism som tillhandahålls av värdepappersföretag Y. Handelsplats M genererar transaktionsidentifieringskoden (TVTIC) "1234".

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #2 värdepappersföretag X
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
12	Kod för köparens beslutsfattare		
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Y
21	Kod för köparens beslutsfattare		
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"false"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget		{NATIONAL_ID} för handlare 1
59	Utförande inom företaget	"NORE"	{NATIONAL_ID} för handlare 2

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Y (DEA-leverantör)	Rapport #1 från värdepappersföretag X (DEA-kund)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> </pre>

<pre> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

I detta scenario är det en handlare inom värdepappersföretag X som fattar investeringsbeslutet och en annan handlare som inger ordern för genomförande. Om endast en handlare är ansvarig för både investeringsbeslutet och utförandet inom värdepappersföretag X ska den nationella identifieringskoden för denna handlare anges i fälten 57 och 59 i rapporten från värdepappersföretag X.

5.28.2 Scenario 2: DEA-kunden handlar för en kunds räkning

5.28.2.1 Alternativ A: Ingen vidarebefordran av kunduppgifter till DEA-leverantören

Exempel 81

Värdepappersföretag X (DEA-kund) använder medlemskoden från värdepappersföretag Y (DEA-leverantör) för att inge en order till handelsplats M. Ordern från värdepappersföretag X avser köp av finansiella instrument på handelsplats M. Värdepappersföretag X handlar för kund 1:s räkning, vars uppgifter inte vidarebefordras till värdepappersföretag Y. Kund 1 har fattat investeringsbeslutet. Inom värdepappersföretag X är handlare 1 ansvarig för ingivandet av ordern för genomförande genom den DEA-mekanism som tillhandahålls av värdepappersföretag Y. Handelsplats M genererar transaktionsidentifieringskoden 1234.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #1 värdepappersföretag X
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{NATIONAL_ID} för kund 1
12	Kod för köparens beslutsfattare		
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag Y
21	Kod för köparens beslutsfattare		
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	"true"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"
57	Investeringsbeslut inom företaget		
59	Utförande inom företaget	"NORE"	{NATIONAL_ID} för handlare 1

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag Y (DEA-leverantör)	Rapport #2 från värdepappersföretag X (DEA-kund)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> ... <Othr> </pre>

<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

5.28.2.2 Alternativ B: Vidarebefordran av kunduppgifter till DEA-leverantören

Exempel 82

Värdepappersföretag X (DEA-kund) använder medlemskoden från värdepappersföretag Y (DEA-leverantör) för att inge en order till handelsplats M. Ordern från värdepappersföretag X avser köp av finansiella instrument på handelsplats M. Värdepappersföretag X handlar för kund 1:s räkning, vars uppgifter vidarebefordras till värdepappersföretag Y enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590. Handelsplats M genererar transaktionsidentifieringskoden 1234.. Eftersom värdepappersföretag X uppfyller villkoren för vidarebefordran enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska det inte rapportera transaktionen.

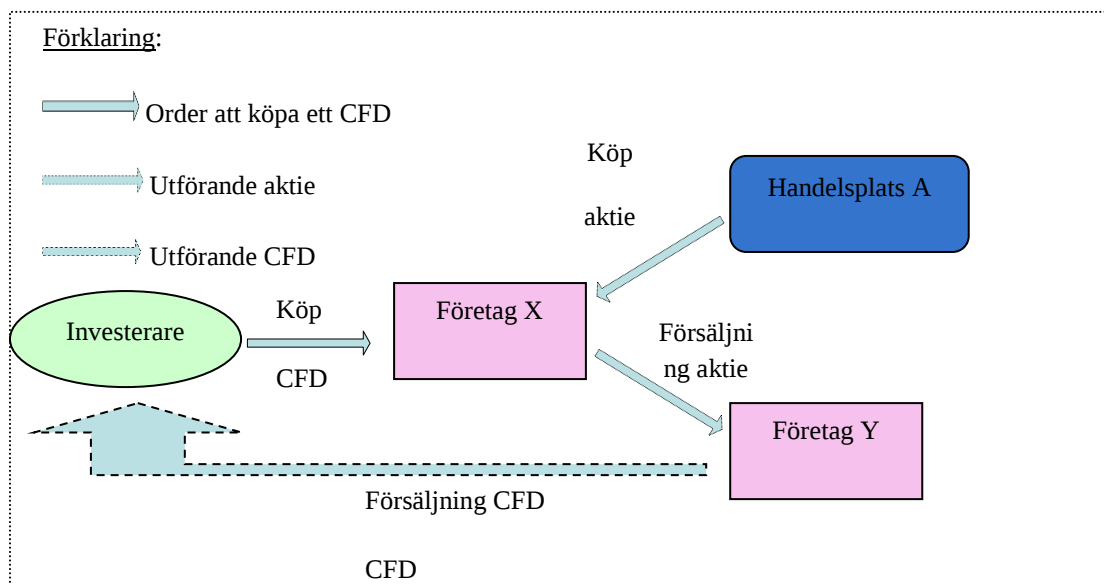
Hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag Y	XML
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"1234"	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgBuyr>12345678901234567890</TrnsmmtgBuyr> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchgid>1234</TradPlcMchgid> </Tx> <ExctgPrsn> <CInt>NORE</CInt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	
7	Köparens identifieringskod	{NATIONAL_ID} för kund 1	
12	Kod för köparens beslutsfattare		
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
21	Kod för köparens beslutsfattare		
25	Uppgift om vidarebefordran av order	"false"	
26	Identifieringskod för det vidarebefordrande företaget för köparen	{LEI} för värdepappersföretag X	
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	
57	Investeringsbeslut inom företaget		
58	Land för den filial som är ansvarig för den person som fattar investeringsbeslutet		
59	Utförande inom företaget	"NORE"	
60	Land för filialen som övervakar den person som ansvarar för utförandet		

5.29 Säkring genom kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)

Exempel 83

Kund 1 ingår en order till värdepappersföretag X för CFD:er på en särskild underliggande aktie (t.ex. Vodafone). Den underliggande aktiens ISIN-kod är GB00BH4HKS39. Värdepappersföretag X köper aktien på handelsplats M (för att förvärva säkringen) och vidarebefordrar denna transaktion (säljer aktien) till värdepappersföretag Y (dess prime broker) som sedan ingår CFD-kontraktet direkt med kund 1. Värdepappersföretagen X och Y handlar båda för egen räkning.



I detta scenario har både värdepappersföretag X och företag Y en skyldighet att rapportera transaktionen, eftersom båda har utfört transaktioner, värdepappersföretag X genom att sälja aktien och värdepappersföretag Y genom att både köpa aktien och sälja CFD:et till kund 1.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 värdepappersföretag X	Värderapport #2 värdepappersföretag X	Värderapport #1 värdepappersföretag Y	Värderapport #2 värdepappersföretag Y ³¹
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y	{NATIONAL_ID} för kund 1

³¹ För ytterligare information om hur CFD-instrument ska rapporteras hänvisas till avsnitt 0.

16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
29	Handelskapt	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"	"DEAL"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"	"XXXX"
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för Vodafone-aktierna	{ISIN} för Vodafone-aktierna	{ISIN} för Vodafone-aktierna	
42	Instrumentets fullständiga namn				"VODAFONE CFD"

XML:

Rapport #1 från värdepappersföretag X	Rapport #2 från värdepappersföretag X	Rapport #1 från värdepappersföretag Y	Rapport #2 från värdepappersföretag Y
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEF</ExctgPty> GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Id> <LEI>ABCDEFGHIJK</LEI> LMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEF</ExctgPty> GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Id> <LEI>FR19620604JEA</LEI> N#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJK</LEI> LMNOPQRST</LEI> </Id>

... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... <FinInstrm> ... <Id>GB00BH4HKS39</Id> ... </FinInstrm> </New> </Tx>	... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> ... <Id>GB00BH4HKS39</Id> ... </FinInstrm> ... </New> </Tx>	... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> ... <Id>GB00BH4HKS39</Id> ... </FinInstrm> ... </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Sellr> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> ... <FinInstrmGnlAttrbts> ... <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> ... </FinInstrmGnlAttrbts> ... </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	--

Värdepappersföretag Y:s rapport #2 ska omfatta information om andra referensuppgifter för instrumentet som inte visas ovan. För rapportering av CFD:er OTC hänvisas till del IV i riktlinjerna.

5.30 Rapportering från en handelsplats om en transaktion som utförs genom dess system enligt artikel 26.5 i MiFIR

Enligt artikel 26.5 i MiFIR ska handelsplatser rapportera uppgifter om transaktioner med finansiella instrument som handlas på deras plattform och som utförs genom deras system av företag som inte omfattas av MiFIR.

Handelsplatsen ska ange alla uppgifter som ett företag skulle ha rapporterat om det hade omfattats av MiFIR, såsom specificeras i tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, inbegripet beteckningen av investeringsbeslutet inom företaget och genomförandet inom företaget, undantag, flaggade uppgifter och beteckningen för att identifiera kunden, i tillämpliga fall. När företaget handlar för egen räkning ska dessa uppgifter tillhandahållas ur företagets perspektiv. Om företaget handlar för en kunds räkning eller på grundval av matchad principalkapacitet eller enligt "annan kapacitet" ska handelsplatsen ange de övriga uppgifterna i fälten 8–15 (om kunden är köpare) eller i fälten 17–24 (om kunden är säljare), och uppgifterna om blankning för kunden och uppgift om råvaruderivat, i förekommande fall. Uppgifterna om blankning och råvaruderivat ska fyllas i ur kundens perspektiv. Vad gäller identifiering av det utförande företaget (fält 4) och dess kund (fälten 7 och 16), när de är berättigade till en LEI, ska villkoren enligt artiklarna 5 och 13.3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 och artikel 26.6 i MiFIR tillämpas. För kunder som inte är berättigade till en LEI-kod ska handelsplatsen kontrollera att den nationella identifiering som tillhandahålls inte innehåller några uppenbara fel eller utelämnanden.

5.30.1 Företag som handlar för egen räkning

Exempel 84

Ett företag som inte är ett värdepappersföretag, företag R, köper finansiella instrument på handelsplats M för en kund. Företag R:s LEI är "RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR". Operatören av handelsplatsen har en LEI på "TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV". Handelsplatsen genererar en identifieringskod för handelsplatstransaktioner (TVTIC) på "55555555" och ett transaktionsreferensnummer för transaktionsrapporten på "6868689".

Hur ska handelsplats M rapportera?

N	Fält	Värden	XML
2	Transaktionens referensnummer	"6868689"	<pre> <Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"55555555"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag R	
5	Värdepappersföretag som omfattas av direktiv 2014/65/EU	"false"	
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för operatören av handelsplats M	
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för företag R	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
29	Handelskapacitet	"DEAL"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	

De fält som är tillämpliga på instrumentet ska fyllas i såsom visas i del IV.

Om det sker en kopplad OTC-transaktion med en kund av företaget ska detta inte rapporteras av handelsplatsen, eftersom den inte utförs genom handelsplatsens system.

5.30.2 Företaget handlar på grundval av matchad principalkapacitet eller enligt "annan kapacitet" för en enskild kunds räkning

Exempel 85

Ett företag som inte är ett värdepappersföretag, företag R, köper aktier från handelsplats M:s orderbok för en kund, företag S, som också handlar för en kund, kund T. Företag R:s LEI är "RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR". Företag S LEI är "SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS". Operatören av handelsplatsen har en LEI på "TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV". Handelsplatsen genererar en identifieringskod för handelsplatstransaktioner (TVTIC) på "55555555" och ett transaktionsreferensnummer för transaktionsrapporten på "6868689".

Om företag R handlar enligt "annan kapacitet" ska handelsplatsen rapportera på följande sätt:

N	Fält	Värden	XML
2	Transaktionens referensnummer	"6868689"	<pre> <Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglId>55555555</TradPlcMtchglId> </Tx> ... </New> </pre>
3	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	"55555555"	
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag R	
5	Värdepappersföretag som omfattas av direktiv 2014/65/EU	"false"	
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för operatören av handelsplats M	
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för företag S	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	
29	Handelskapacitet	"AOTC"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	

			</Tx>
--	--	--	-------

De fält som är tillämpliga på instrumentet ska fyllas i såsom visas i del IV.

Eftersom företag R handlar enligt "annan kapacitet" krävs att den transaktionsrapport som handelsplatsen ingår identifierar den direkta underliggande kunden (företag S) och inte kund T.

Om företag R handlade på grundval av matchad principalkapacitet skulle rapporteringen vara identisk, förutom att det i fältet avseende handelskapacitet i stället ska anges "MTCH".

5.30.3 Företag ackumulerar order från flera kunder

När ett företag ackumulerar order för flera kunder på en handelsplats och handlar enligt "annan kapacitet" eller på grundval av matchad principalkapacitet ska handelsplatsen rapportera uppgifterna om varje kund. Detta ska omfatta rapportering av ytterligare uppgifter i fälten 8–15 för en köpare och motsvarande fält för en säljare, och uppgift om blankning för kunden och uppgift om råvaruderivat för kunden, i förekommande fall.

Exempel 86

Ett företag som inte är ett värdepappersföretag, företag R, köper aktier från handelsplats M:s orderbok för tre kunder, A, B och C. Företag R handlar enligt "annan kapacitet". Operatören av handelsplatsen har en LEI på "TVTVTVTVTVTVTVTVTV". Handelsplatsen genererar en identifieringskod för handelsplatstransaktioner (TVTIC), "55555555", och ett transaktionsreferensnummer för transaktionsrapporten avseende marknadssidan på "6868689" och för tilldelningarna till kunderna på "6868690", "6868691" och "6868692".

Hur ska handelsplats M rapportera?

N	Fält	Värderapport #1 handelsplats M	Värderapport #2 handelsplats M	Värderapport #3 handelsplats M	Värderapport #4 handelsplats M
2	Transaktionens referensnummer	"6868689"	"6868690"	"6868691"	"6868692"
3	Handelsplatsens identifieringskod	"55555555"			
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för företag R	{LEI} för företag R	{LEI} för företag R	{LEI} för företag R
5	Värdepappersföretag som omfattas av direktiv 2014/65/EU	"false"	"false"	"false"	"false"
6	Identifieringskod för den inlämnande enheten	{LEI} för operatören av handelsplats M	{LEI} för operatören av handelsplats M	{LEI} för operatören av handelsplats M	{LEI} för operatören av handelsplats M

7	Köparens identifieringskod	"INTC"	{LEI} för kund A	{LEI} för kund B	{LEI} för kund C
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP för handelsplats M	"INTC"	"INTC"	"INTC"
29	Handelskapacitet	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"	"AOTC"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	"XOFF"	"XOFF"	"XOFF"

XML:

Rapport #1 från handelsplats M	Rapport #2 från handelsplats M	Rapport #3 från handelsplats M	Rapport #4 från handelsplats M
<pre> <Tx> <New> <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868690</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868691</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868692</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCC CCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </pre>

<code><TradPlcMtchId>5555 5555</TradPlcMtchId > </Tx> ... </New> </Tx></code>	<code></New> </Tx></code>	<code></Tx> ... </New> </Tx></code>	<code>... <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... </New> </Tx></code>
---	---	--	--

Om företag R handlade på grundval av matchad principkapacitet skulle rapporteringen vara identisk, förutom att det i fältet avseende handelskapacitet i stället ska anges "MTCH".

5.31 Transaktioner för värdepappersfinansiering

För en allmän beskrivning av hur rapporteringsskyldigheten är tillämplig på transaktioner för värdepappersfinansiering, se det relevanta underavsnittet i 5.6.2 (undantag enligt artikel 2.5 a i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590).

Exempel 87

Centralbanken CB (med LEI CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB) köper statsobligationer (ISIN NO0010732555) från värdepappersföretag X.

Den transaktionsrapport som visas nedan är enbart ur värdepappersföretag X:s perspektiv.

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<code><Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</Exctg Pty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <FinInstrm> <Id>NO0010732555</Id> </FinInstrm> <AddtlAttrbts></code>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för centralbanken CB	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för statsobligationen	
65	Uppgift om transaktioner för värdepappersfinansiering	"true"	

			<pre> ... <SctiesFincgTxInd>true</SctiesFinc gTxInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

DEL IV – Rapportering av olika slags instrument

5.32 Principer

När ett derivatinstrument är på ett annat derivatinstrument, till exempel en option på en aktietermin, ska ISIN-koden för det direkt underliggande instrumentet, dvs. terminsavtalet i detta exempel, anges i fältet för kod för underliggande instrument (fält 47) i transaktionsrapporten, snarare än det slutliga underliggande instrumentet (aktier i detta exempel). Detta skulle inte vara tillämpligt på ett derivat som är upptaget till handel på en handelsplats, eftersom endast instrumentets identifieringskod (fält 41) är tillämplig.

"NOAP" ska anges i fältet avseende pris när något pris inte är tillämpligt i en viss transaktion (t.ex. vid gåvor). "PNDG" är tillämpligt när priset inte är tillgängligt utan inväntas. Värdet "0" får inte användas som ett standardvärde.

Finansiella instrument där det underliggande är ett index ska rapporteras. Detta omfattar även situationer som avser ett index *"bestående av finansiella instrument som handlas på en handelsplats"*. I detta avseende ska det påpekas att texten *"bestående av finansiella instrument som handlas på en handelsplats"* i artikel 26.2 c i MiFIR ska läsas som hänvisning både till ett index och en korg.

5.33 Identifiering av finansiella instrument som handlas på en handelsplats eller som är tillgängliga i Esmas förteckning

Exempel 88

Ett värdepappersföretag förvärvar ett finansiellt instrument med ISIN-kod BE9999999999.

N	Fält	Värden	XML
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	<pre> <Tx> <New> .. <FinInstrm> <Id>BE9999999999</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
42	Instrumentets fullständiga namn		
43	Instrumentets klassificering		
44	Teoretisk valuta 1		
45	Teoretisk valuta 2		
46	Prismultiplikator		
47	Kod för underliggande instrument		
48	Namn på underliggande index		
49	Löptid för underliggande index		
50	Optionsslag		
51	Lösenpris		

52	Lösenprisvaluta		
53	Typ av optionsinlösen		
54	Förfallodag		
55	Giltighet		
56	Leveranstyp		

I detta fall ska endast fältet för instrumentets identifieringskod fyllas i. Om fälten som rör instrumentets referensuppgifter också tillhandahålls ska behöriga myndigheter emellertid inte avvisa transaktionsrapporten.

5.34 Identifiering av finansiella instrument som inte handlas på en handelsplats eller är tillgängliga i Esmas förteckning

5.34.1 Finansiella instrument som handlas på en organiserad handelsplattform utanför unionen (handelsplats utanför EES)

Exempel 89

Ett värdepappersföretag handlar med derivativa terminsavtal (ISIN US0000000000) för 11,4653 dollar per underliggande instrument på en organiserad handelsplattform utanför unionen (handelsplattform U). Det underliggande instrumentet (ISIN GB0000000000) handlas på en handelsplats.

Antal enheter av det underliggande värdepapper som representeras av ett enda derivatkontrakt är 1 000.

CFI-koden för terminsavtalet är FFSCSX och avtalet avvecklas kontant.

MIC-segmentet från handelsplatsen utanför EES är XUSA och terminsavtalet löper ut den 19 juni 2018.

N	Fält	Värden	XML
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplattform U	<pre> <New> ... <Tx> ... <TradVn>XUSA</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000000</Id> <FullNm>FUTURE CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrygInstrm> <Othr> </pre>
41	Instrumentets identifieringskod	{Terminer ISIN}	
42	Instrumentets fullständiga namn	"TERMINSAVTAL"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1000"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande värdepapper	
55	Giltighet	"2018-06-19"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </pre>
--	--	--	--

Om ett finansiellt instrument som handlas på en organiserad handelsplattform utanför unionen har en ISIN ska detta anges i fält 41. Fälten 42–56 ska även fyllas i om denna ISIN inte finns med i förteckningen över referensuppgifter från Esma.

5.34.2 OTC-derivat

Exempel 90

Ett värdepappersföretag handlar derivativa terminsavtal OTC. De derivativa terminsavtalen har ingen ISIN men det underliggande instrumentet (ISIN GB0000000000) är upptaget till handel eller handlas på en handelsplats.

Antal enheter av det underliggande värdepapper som representeras av ett enda derivatkontrakt är 1 000.

Terminsavtalets CFI-kod är FFSCSX och det löper ut den 19 juni 2018. Avtalet levereras kontant.

Fältet för prismultiplikatorn ska även fyllas i med hänvisning till det direkta underliggande instrumentet.

N	Fält	Värden	XML
36	Handelsplats	"XXXX"	<pre> <New> ... <Tx> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> ... <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FUTURE CONTRACT JUN 2018</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-6-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </pre>
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"FUTURE CONTRACT JUN 2018"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1000"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande instrument	
55	Giltighet	"2018-06-19"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			</Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	--

Skillnaden mellan 5.34.1 och 5.34.2 är att instrumentets identifieringskod (fält 41) inte ska anges i scenario 5.34.2.

5.35 Rapportering av särskilda finansiella instrument

5.35.1 Aktier eller aktieliknande instrument

Exempel 91

Ett värdepappersföretag handlar 10 ADR (ISIN: US0000000001) på den amerikanska marknaden (MIC:XUSA). Det underliggande instrumentet (ISIN: GB0000000001) är upptaget till handel på en handelsplats eller handlas på en handelsplats. CFI-koden är EDSXFB.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"10"	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> ... <TradVn>XUSA</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000001</Id> <ClssfctnTp>EDSRFB</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm>
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande instrument	

			... </New> </Tx>
--	--	--	------------------------

5.35.2 Obligationer eller andra former av skuldförbindelser

5.35.2.1 Scenario där transaktionen utfördes till ett rent (clean) pris³²

Exempel 92

Ett värdepappersföretag förvärvar ett finansiellt instrument i form av en obligation eller en skuldförbindelse EDF 2,25 % 2021 (ISIN-kod FR0011637586) genom OTC-handel på 98. Transaktionens nominella belopp är 1 000 000 euro.

Nettobeloppet för transaktionen är 982 650,68 euro.

Följande omständigheter ska beaktas i detta exempel:

De statistiska egenskaperna (såsom de definieras vid utfärdandet av det finansiella instrumentet) är följande:

- Förfallodag: 27 april 2021
- Nominell kupong: 2,25 %
- Kupongfrekvens: årlig
- Day Count Convention (ränteberäkningskonvention): ACT/ACT (dvs. faktisk/faktisk)³³
- Day to Settle Convention (konvention om avvecklingsdag): två affärsdagar efter handelsdagen

Variablerna (dynamiska egenskaper som beror på marknadsvillkoren) är följande:

- Handelsdag: 5 juni 2014
- Avvecklingsdag: 9 juni 2014 (enligt Day to Settle Convention)
- Sista kupongdatum: 27 april 2014
- Nästa kupongdatum: 27 april 2015
- Antal ackumulerade dagar: 43 (dvs. antalet dagar mellan sista kupongdatumet och avvecklingsdagen)
- Grundperiod: 365 (dvs. antalet dagar mellan sista kupongdatumet och nästa kupongdatum)

³² Rent pris = totalpris-upplupen ränta.

³³ ACT/ACT är den konvention för obligationer som rekommenderas av ICMA.

- Kvantitet: 1 000 000 (dvs. transaktionens nominella eller monetära värde)
- Rent pris: 98
- Upplupen ränta: 0,26506849 (dvs. $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2.25}{1} \times \frac{43}{365}$)

Nominal coupon	nominell kupong
Annual Coupon Frequency	årlig kupongfrekvens
Accrued Number of Days	antal ackumulerade dagar
Period Basis	grundperiod

- Totalpris: 98,26506849 (dvs. rent pris + upplupen ränta = 98 + 0,26506849)

Nettobeloppet ska beräknas på följande sätt (i enlighet med formeln som föreskrivs i fält 35 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590):

Nettobelopp = (rent pris x nominellt värde) + (upplupna kuponger x nominellt värde), dvs. $(\frac{98}{100} \times 1\,000\,000 \text{ euro}) + (\frac{0.26506849}{100} \times 1\,000\,000) = 982\,650,68$

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"1000000"	$\langle \text{Tx} \rangle$ $\langle \text{New} \rangle$... $\langle \text{Tx} \rangle$... $\langle \text{Qty} \rangle$ $\langle \text{NmnlVal} \text{ Ccy}=\text{"EUR"}>1000000</\text{NmnlVal} \rangle$ $\langle \text{Qty} \rangle$ $\langle \text{Pric} \rangle$ $\langle \text{Pric} \rangle$ $\langle \text{Pctg} \rangle 98 </\text{Pctg} \rangle$ $\langle \text{Pric} \rangle$ $\langle \text{NetAmt} \rangle 982650.68 </\text{NetAmt} \rangle$ $\langle \text{TradVn} \rangle \text{XOFF} </\text{TradVn} \rangle$ $\langle \text{Tx} \rangle$ $\langle \text{FinInstrm} \rangle$ $\langle \text{Id} \rangle \text{FR0011637586} </\text{Id} \rangle$ $\langle \text{FinInstrm} \rangle$... $\langle \text{New} \rangle$ $\langle \text{Tx} \rangle$
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"98"	
35	Nettobelopp	"982650,68"	
36	Handelsplats	"XOFF"	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.2.2 Scenario där priset på det finansiella instrumentet motsvarar diskonteringsavkastningen

Exempel 93

Ett värdepappersföretag förvärvar nederländska statsskuldväxlar DTB 0 % 12/30/16 (ISIN-kod NL0011923107) genom handel på -0,609 %. Transaktionens nominella värde är 1 000 000 euro.

Nettobeloppet för transaktionen är 1 002 611,97 euro.

Följande omständigheter ska beaktas i detta exempel:

De statistiska egenskaperna (såsom de definieras vid utfärdandet av det finansiella instrumentet) är följande:

- Förfallodag: 30 december 2016
- Day Count Convention: ACT/360
- Day to Settle Convention: två affärsdagar efter handelsdagen

Variablerna (dynamiska egenskaper som beror på marknadsvillkoren) är följande:

- Handelsdag: 27 juli 2016
- Avvecklingsdag: 29 juli 2016
- Antal dagar till förfallodagen: 154 (dvs. antalet dagar från avvecklingsdagen till förfallodagen)
- Grundperiod: 360 (dvs. det totala antalet dagar enligt konventionen)
- Kvantitet: 1 000 000 (dvs. transaktionens nominella eller monetära värde)
- Växelns diskonteringsavkastning: -0,609 %
- Rent pris: 100,261197 (dvs. $\frac{100}{1 + \frac{\text{Yield} \times \text{Days until maturity}}{100 \times \text{Period Basis}}} = \frac{100}{1 + \frac{-0.609 \times 154}{100 \times 360}}$)

Yield	avkastning
Days until maturity	antal dagar till förfallodagen
Period Basis	grundperiod

- Totalpris: 100,261197 (dvs. rent pris + upplupen ränta = 100,261197 + 0)

Nettobeloppet ska beräknas på följande sätt (i enlighet med formeln som föreskrivs i fält 35 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590):

Nettobelopp = (rent pris x nominellt värde) + (upplupna kuponger x nominellt värde), dvs. $(\frac{100.261197}{100} \times 1\,000\,000 \text{ euro}) + (0 \times 1\,000\,000 \text{ euro}) = 1\,002\,611,97 \text{ euro}$

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"1000000"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Yld>-0.609</Yld> </Pric> </Pric> <NetAmt>1002611.97</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>NL0011923107</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"-0,609"	
34	Prisvaluta		
35	Nettobelopp	1002611,97	
36	Handelsplats	"XOFF"	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.2.3 Scenario där priset på det finansiella instrumentet (nollkupongare) motsvarar obligationens avkastning

Exempel 94

Ett värdepappersföretag förvärvar en strip FRTR 0 % 04/25/2041 (ISIN-kod FR0010773200) genom OTC-handel på 1,06 %. Transaktionens nominella värde är 1 000 000 euro.

Nettobeloppet för transaktionen är 770 343,52 euro.

Följande omständigheter ska beaktas i detta exempel:

De statiska egenskaperna (såsom de definieras vid utfärdandet av det finansiella instrumentet) är följande:

- Förfallodag: 25 april 2041
- Kupongfrekvens: ingen
- Day Count Convention: ACT/ACT
- Day to Settle Convention: två affärsdagar efter handelsdagen

Variablerna (dynamiska egenskaper som beror på marknadsvillkoren) är följande:

- Handelsdag: 25 juli 2016

- Avvecklingsdag: 27 juli 2016
- Grundperiod: 365
- Tid till förfallodagen (från avvecklingsdagen den 27 juli 2016 till förfallodagen den 25 april 2041):
"(24+272/365) år"
- Kvantitet: 1 000 000 (dvs. transaktionens nominella eller monetära värde)
- Stripens obligationsavkastning: 1,06 %
- Rent pris: 77,0343516 (dvs. $\frac{100}{(1+\frac{Yield}{100})^{Time\ to\ maturity}} = \frac{100}{(1+\frac{1.06}{100})^{(24+\frac{272}{365})}}$)

Yield	avkastning
Time to maturity	tid till förfallodagen

- Totalpris: 77,0343516 (dvs. rent pris + upplupen ränta = 77,0343516 + 0)

Nettobeloppet ska beräknas på följande sätt (i enlighet med formeln som föreskrivs i fält 35 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590):

Nettobelopp = (rent pris x nominellt värde) + (upplupna kuponger x nominellt värde), dvs. $(\frac{77.0343516}{100} \times 1\,000\,000\text{ euro}) + (0 \times 1\,000\,000\text{ euro}) = 770343,52\text{ euro}$

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"1000000"	$\langle Tx \rangle$ $\langle New \rangle$... $\langle Tx \rangle$... $\langle Qty \rangle$ $\langle NmnlVal \rangle$ $Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>$ $\langle Qty \rangle$ $\langle Pric \rangle$ $\langle Pric \rangle$ $\langle Yld \rangle 1.06 </Yld>$ $\langle Pric \rangle$ $\langle NetAmt \rangle 770343.52 </NetAmt>$ $\langle TradVn \rangle XOFF </TradVn>$ $\langle Tx \rangle$ $\langle FinInstrm \rangle$ $\langle Id \rangle FR0010773200 </Id>$ $\langle FinInstrm \rangle$... $\langle New \rangle$ $\langle Tx \rangle$
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"1,06"	
34	Prisvaluta		
35	Nettobelopp	770343,52	
36	Handelsplats	"XOFF"	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.2.4 Konvertibel obligation

5.35.2.4.1 Scenario där priset på den konvertibla obligationen uttrycks i rent pris:

Exempel 95

Ett värdepappersföretag förvärvar Vodafone 2 % 02/25/2019 (ISIN-kod XS1371473601) genom OTC-handel på 114,00. Transaktionens nominella värde är 1 000 000 GBP.

Nettobeloppet för transaktionen är 1 148 406,59 GBP.

Följande omständigheter ska beaktas i detta exempel:

De statistiska egenskaperna (såsom de definieras vid utfärdandet av det finansiella instrumentet) är följande:

- Förfallodag: 25 februari 2019
- Nominell kupong: 2 %
- Kupongfrekvens: halvårsvis
- Day Count Convention: ICMA ACT/ACT
- Day to Settle Convention: två affärsdagar efter handelsdagen

Variablerna (dynamiska egenskaper som beror på marknadsvillkoren) är följande:

- Handelsdag: 25 juli 2016
- Avvecklingsdag: 27 juli 2016
- Sista kupongdatum: 25 februari 2016
- Nästa kupongdatum: 25 augusti 2017
- Antal ackumulerade dagar: 153 (dvs. antalet dagar mellan sista kupongdatumet och avvecklingsdagen)
- Grundperiod: 182 (dvs. antalet dagar mellan sista kupongdatumet och nästa kupongdatum)
- Kvantitet: 1 000 000 (dvs. transaktionens nominella eller monetära värde)
- Rent pris: 114,00
- Upplupen ränta: 0,84065934 (dvs. $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2}{2} \times \frac{153}{182}$)

Nominal Coupon	nominell kupong
Annual Coupon Frequency	årlig kupongfrekvens
Accrued Number of Days	antal ackumulerade dagar

Period Basis	grundperiod
--------------	-------------

- Totalpris: 114,8406593 (dvs. rent pris + upplupen ränta = 114,00 + 0,84065934)

Nettobeloppet ska beräknas på följande sätt (i enlighet med formeln som föreskrivs i fält 35 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590):

Nettobelopp = (rent pris x nominellt värde) + (upplupna kuponger x nominellt värde), dvs. $(\frac{114}{100} \times 1\,000\,000 \text{ GBP}) + (\frac{0.84065934}{100} \times 1\,000\,000 \text{ GBP}) = 1\,148\,406,59 \text{ GBP}$

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"1000000"	$\langle Tx \rangle$ $\langle New \rangle$... $\langle Tx \rangle$... $\langle Qty \rangle$ $\langle NmnIVal \rangle$ $Ccy="GBP">1000000</NmnIVal>$ $\langle Qty \rangle$ $\langle Pric \rangle$ $\langle Pric \rangle$ $\langle Pctg \rangle 114.00 </Pctg>$ $\langle Pric \rangle$ $\langle NetAmt \rangle 1148406.59 </NetAmt>$ $\langle TradVn \rangle XOFF </TradVn>$ $\langle Tx \rangle$ $\langle FinInstrm \rangle$ $\langle Id \rangle XS1371473601 </Id>$ $\langle FinInstrm \rangle$... $\langle New \rangle$ $\langle Tx \rangle$
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"114,00"	
35	Nettobelopp	"1148406,59"	
36	Handelsplats	"XOFF"	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.2.4.2 Scenario där priset på det finansiella instrumentet uttrycks i handelsvalutan

Exempel 96

Ett värdepappersföretag förvärvar 10 000 konvertibla obligationer CapGemini 0 % 01/01/19 (ISIN-kod FR0011600352) genom OTC-handel på 80 euro. Transaktionen nettobelopp uppgår till 800 000 euro = 10 000 x 80 euro.

Följande omständigheter ska beaktas i detta exempel:

De statiska egenskaperna (såsom de definieras vid utfärdandet av det finansiella instrumentet) saknar betydelse för transaktionsrapporteringen.

Variablerna (dynamiska egenskaper som beror på marknadsvillkoren) är följande:

- Kvantitet: 10 000 (dvs. antalet enheter av det finansiella instrumentet)

- Pris för det finansiella instrumentet enligt handelsvalutan: 80 euro

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"10000"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">80</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <NetAmt>800000</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0011600352</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	Kvantitetsvaluta		
33	Pris	"80"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
35	Nettobelopp	"800000"	
36	Handelsplats	"XOFF"	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.3 Optioner

5.35.3.1.1 Aktieoption

Exempel 97

Ett värdepappersföretag köper 10 köpoptioner för aktier för 11,46 euro per avtal från ett annat värdepappersföretag. Köpoptionen handlas inte på en handelsplats, men däremot den underliggande aktien.

Prismultiplikatorn (antalet underliggande aktier som representeras i ett avtal) är 5. Lösenpriset (pris för vilket de underliggande aktierna köps eller säljs om optionen löses in) är 70 euro. Aktiens ISIN är DE0000000001. CFI-koden är HESAVP.

Optionsavtalet löper ut den 31 december 2018 och avvecklas fysiskt.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"10"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> </pre>
33	Pris	"11,46"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
51	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		

42	Instrumentets fullständiga namn	"EQUITY CALL OPTION"	<pre> <Unit>10</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">11.46</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>EQUITY CALL OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HESAVP</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>5</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">70</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>PHYS</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"5"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande aktie	
50	Optionsslag	"CALL"	
51	Lösenpris	"70"	
52	Lösenprisvaluta	"EUR"	
53	Typ av optionsinlösen	"EURO"	
55	Giltighet	"2018-12-31"	
56	Leveranstyp	"PHYS"	

5.35.3.1.2 OTC indexbaserat optionsavtal

Exempel 98

Ett värdepappersföretag säljer 50 FTSE 100 indexbaserade köpoptioner OTC för 2 GBP per avtal.

Det underliggande är FTSE 100 Index (ISIN: GB0001383545).

Förfallodag är den 14 augusti 2018. Lösenpris är 3 500 och prismultiplikator är 25. Optionsavtalet är av europeiskt snitt och levereras mot kontanter.

CFI-koden för optionsavtalet är HEIAVC.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"50"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>50</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">2</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HEIAVC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-08-14</XpryDt> <PricMltplr>25</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0001383545</ISIN> </Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Othr> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> </pre>
33	Pris	"2"	
34	Prisvaluta	"GBP"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"25"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande index	
48	Namn på underliggande index	{infoga namn på index}	
50	Optionsslag	"CALL"	
51	Lösenpris	"3500"	
53	Typ av optionsinlösen	"EURO"	
55	Giltighet	"2018-08-14"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <BsisPts>3500</BsisPts> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

5.35.4 Kontrakt avseende prisdifferenser (CFD)

Exempel 99

Värdepappersföretag X handlar ett CFD. Den underliggande Vodafone-aktien är upptagen till handel på en reglerad marknad, men CFD:et handlas inte på en handelsplats.

Antalet CFD som omfattas av handeln är 10 000. Priset för ett CFD är 3,374 euro. ISIN-koden för den underliggande aktien (Vodafone) är GB00BH4HKS39.

CFI-koden för CFD:et är JESXCC. Prismultiplikatorn är 1, vilket speglar det faktum att ett CFD-avtal representerar en enhet av det underliggande instrumentet.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"10000"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">3.374</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> </FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> <ClssfctnTp>JESXCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> </pre>
33	Pris	"3,374"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"VODAFONE CFD"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande aktie	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB00BH4HKS39</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.5 Spreadbetting

5.35.5.1 Spreadbetting på aktier

Exempel 100

En investerare handlar med en daglig löpande s.k. spreadbetting (spekulation huruvida priset på en aktie kommer att gå upp eller ner inom ett visst intervall) på en aktie. Denna spreadbetting handlas inte på en handelsplats, men däremot den underliggande aktien.

Det belopp som satsats är 0,5 GBP per prISRörelse i valutans mindre enhet.

Referenspriset för det underliggande finansiella instrumentet (ABC PLC) är 102,23 euro.

Instrumentets fullständiga namn är ett fritt textfält som ska fyllas i av den utförande enheten: ABC BET SEP 15 SPREAD. CFI-koden för spreadbetting på aktier är JESXSC.

Prismultiplikatorn är rörelsen per procentenhet i priset för det underliggande instrumentet: 100, dvs. 100 cent för 1 euro. Därför justeras investerarens vinst eller förlust med 0,50 GBP för varje cents rörelse.

ISIN-koden för den underliggande aktien är GB0000000004.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"0,50"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">0.50</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">102.23</Amt> </MntryVal> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"102,23"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"ABC BET SPREAD"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	

46	Prismultiplikator	"100"	<pre> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ABC BET SPREAD</FullNm> <ClssfctnTp>JESXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>100</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000004</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande aktie	
55	Giltighet		
56	Leveranstyp	"CASH"	

För daglig löpande spreadbetting krävs endast att den ursprungliga inledande transaktionen och den slutgiltiga transaktion genom vilken avtalet avslutas rapporteras. Giltigheten ska inte anges.

5.35.5.2 Spreadbetting på en obligationstermin

Exempel 101

I fältet avseende kod för underliggande instrument (fält 47) i transaktionsrapporten ska ISIN-koden från det direkt underliggande finansiella instrumentet anges. I detta exempel är det identifieringskoden för obligationsterminsavtalet och inte för det ursprungliga underliggande finansiella instrumentet (dvs. obligationen).

En investerare handlar med ett dagligt löpande spreadbettingavtal där obligationsterminen handlas på en handelsplats.

Det belopp som satsas är 2 GBP per punkt. Referenspriset (i baspunkter) för det underliggande finansiella instrumentet är 9 100.

Instrumentets fullständiga namn är ett fritt textfält som ska fyllas i av den utförande enheten: Obligationstermin BET 27MAY15.

CFI-koden för en spreadbetting på en obligationstermin är JCAXSC.

Prismultiplikatorn är rörelsen per procentenhet i priset för det underliggande instrumentet: 1. ISIN-koden för den underliggande obligationsterminen är GB1234567891.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"2"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>9100</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>BOND FUTURE BET 27MAY15</FullNm> <ClssfctnTp>JCAXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB1234567891</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"9100"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"BOND FUTURE BET 27MAY15"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande termin	
55	Giltighet		
56	Leveranstyp	"CASH"	

5.35.5.3 Spreadbetting på ett index

Exempel 102

En investerare handlar ett spreadbettinginstrument på ett aktieindex som består av minst ett finansiellt instrument som är upptaget till handel på en handelsplats. Detta spreadbettinginstrument handlas inte på en handelsplats.

Det belopp som satsas är 10 GBP per indexpunktrörelse och referenspriset för det underliggande finansiella instrumentet är 9 340.

Instrumentets fullständiga namn är ett fritt textfält som ska fyllas i av den utförande enheten: FTSE Index BET.

CFI-koden för detta spreadbettinginstrument på ett aktieindex är JEIXSC.

Spreadbettingpositionen löper ut T+1 där T är 2018-10-27.

Prismultiplikatorn är rörelse per indexpunkt, dvs. 1. För varje indexpunktrörelse justeras investerarens vinst eller förlust med 10 GBP.

Indexets ISIN-kod är GB0001383545.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"10"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>9340</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FTSE INDEX BET</FullNm> <ClssfctnTp>JEIXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-10-28</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <Indx> <ISIN>GB0001383545</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"9340"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"FTSE INDEX BET"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande index	
48	Namn på underliggande index	"FTSE100"	
55	Giltighet	"2018-10-28"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

5.35.5.4 Spreadbetting på ett OTF-handlat FX-räntesäkringsavtal (FRA)

Exempel 103

En investerare utför en spreadbetting på ett ettårigt räntesäkringsavtal GBP/USD (GBP/USD FRA JUN16). Detta spreadbettinginstrument handlas inte på en handelsplats.

GBP/USD FRA JUN16 handlas för 1,5355 (växelkurs).

Det belopp som satsas är 5 GBP per rörelse i valutans mindre enhet. Prismultiplikatorn är rörelsen per procentpunkt i den mindre enheten i referenspriset för det underliggande instrumentet. 100.

ISIN för GBP/USD FRA JUN16 är GB0000000006.

CFI-koden för denna spreadbetting på GBP/USD-räntesäkringsavtalet är JFRXSC.

Utgångsdatum för räntesäkringsavtalet är den 30 juni 2016 och det är förfallodatum för detta spreadbettinginstrument.

Nämnda spreadbettinginstrument ska levereras kontant.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"5"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">5</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">1.5355</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>GBP/USD FRA JUN16 BET</FullNm> <ClssfctnTp>JFRXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-30</XpryDt> <PricMltplr>100</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"1,5355"	
34	Prisvaluta	"GBP"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"GBP/USD FRA JUN16 BET"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"100"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande räntesäkringssavtal	
55	Giltighet	"2016-06-30"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <Sngl> <ISIN>GB0000000006</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

5.35.5.5 Spreadbetting på en OTF-handlad ränteoption

Exempel 104

En investerare placerar en spreadbetting på 2 GBP per baspunkt på en 6-månaders GBP LIBOR-option.

6-månaders LIBOR pund-optionen handlas för 0,71375 procent på T. ISIN för denna 6-månaders GBP LIBOR-option är GB0000000007.

CFI-koden för detta spreadbettinginstrument på pund LIBOR-optionen är JRMXSC.

Utgångsdatumet för denna GBP LIBOR-option är den 17 december 2018, vilket även är förfallodatum för nämnda spreadbetting.

Prismultiplikatorn är 10 000 eftersom 1 baspunkt är 0,01 %. Investerarens vinst eller förlust justeras med 2 GBP för varje rörelse på 0,01 procent av referenspriset.

N	Fält	Värden	XML
30	Kvantitet	"2"	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0.71375</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>OPTION GBP LIBOR DEC15 BET</FullNm> <ClssfctnTp>JRMXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> </pre>
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"0,71375"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"OPTION GBP LIBOR DEC15 BET"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"10000"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande option	
55	Giltighet	"2018-12-17"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-17</XpryDt> <PricMltplr>10000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000007</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Det underliggande instrument som identifieras i transaktionsrapporten är ränteoptionsavtalet.

5.35.6 Kreditswap

Exempel 105

Värdepappersföretag X köper en kreditswap OTC på Allianz SE med ett värde på 1 000 000 (en miljon) euro för en kupong på 100 baspunkter från värdepappersföretag Y. Kreditswappen avvecklas kontant.

Kreditswappen löper ut den 30 juli 2020.

Värdepappersföretag X tar emot en förskottsbetalning från värdepappersföretag Y på 33 879 euro.

ISIN för den underliggande obligationen är ZA2344558978 och den handlas på en handelsplats. Kreditswappens CFI är SCUCCC.

Transaktionsrapporten nedan är enbart upprättad ur värdepappersföretag X:s perspektiv.

N	Fält	Värden	XML
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	
30	Kvantitet	"1000000"	
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"100"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
38	Förskottsbetalning	"-33879"	
39	Valuta för förskottsbetalning	"EUR"	
41	Instrumentets identifieringskod		
			<pre> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </pre>

42	Instrumentets fullständiga namn	"ALLIANZ SE SNR CDS"	</Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">33879</Amt> <Sgn>>false</Sgn> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ALLIANZ SE SNR CDS</FullNm> <ClssfctnTp>SCUCCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2021-06-20</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>ZA2344558978</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> .. </New> </Tx>
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande obligation	
55	Giltighet	"2021-06-20"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

Om det inte ske någon förskottsbetalning ska "0" anges i fält 38.

Om värdepappersföretag X erhåller förskottsbetalningen snarare än betalar den ska värdet på förskottsbetalningen i fält 38 vara negativt.

5.35.7 Swappar

Om det förekommer separata kassaflöden vid transaktionen och riktningen inte kan anges genom hänvisning till fältet för säljare/köpare ska detta anges genom användning av ett "+" eller "-" framför den underliggande instrumentkoden eller det underliggande indexnamnet, i förekommande fall. Ett "+" visar

att köparen erhåller (uppfyllelse av det) det underliggande, medan ett "-" visar att köparen betalar det (uppfyllelse av det) underliggande. Dessa "+" och "-" har visats i tabellerna i exemplen för att illustrera swappens riktning. Dessa symboler kommer emellertid att visas i XML-schemat som XML-taggar som följer med det relevanta värde som ska rapporteras (t.ex.. den underliggande instrumentkoden). "+" eller "-" anges som "Swpln" eller "SwpOut" i XML-texten.

Värdepappersföretagen förväntas använda "-" och "+" på ett korrekt och konsekvent sätt. Om köparen eller säljaren i ett swapavtal inte kan utläsas av beskrivningen i de relevanta fälten enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590, t.ex. vid en aktieswap med två aktiedelar, ska "+" och "-" i fälten 47 och/eller 48 på ett korrekt sätt spegla vad det företaget, vilket identifieras som köpare i transaktionsrapporten, erhåller och vad det företag, vilket identifieras som säljare i transaktionsrapporten, betalar.

Förskottsbetalningen kan vara tillämplig på alla swapavtal.

5.35.7.1 Aktieswap (en aktiedel)

Exempel 106

Värdepappersföretag X handlar en aktieswap OTC med värdepappersföretag Y. Den underliggande aktien är upptagen till handel på en handelsplats. Företag X bär risken för en prisrörelse för den underliggande aktien och betalar LIBOR3M plus en premie på 0,05 %.

Swapavtalets nominella värde är 1 000 000 euro och referenspriset för den underliggande aktien är 50 USD. Swapavtalet löper ut den 31 december 2018 och avvecklas kontant.

Instrumentets fullständiga namn är BAYER EQS LIBOR3M+ 0,05 %. Aktieswappens CFI-kod är SESPXC.

Den underliggande aktien är Bayer AG NA (ISIN DE000BAY0017).

Den underliggande räntesatsen är LIBOR3M på 3,7 %+ 0,05 % med en löptid på 3 månader.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värden	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	
30	Kvantitet	"1000000"	
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"0,05"	
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		

42	Instrumentets fullständiga namn	"BAYER EQS LIBOR3M+0,05 % SEP 15"	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0.05</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>DE000BAY0017</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>MNTH</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr>
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	"+"DE000BAY0017"	
48	Namn på underliggande index	"-"LIBO"	
49	Löptid för underliggande index	"3"MNTH"	
55	Giltighet	"2018-12-31"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			</FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	--

Observera att fält 30 avseende kvantitet ska innehålla det nominella värdet för den rapporterade transaktionen rörande swapavtalet. I fält 46 avseende prismultiplikator ska det antal swapavtal anges som handlas vid transaktionen. Fält 33 avseende pris ska innehålla den spread som i förekommande fall betalas/erhålls utöver den underliggande räntesatsen.

"+" före koden för det underliggande instrumentet visar att köparen erhåller resultatet från BAYER AG NA.

"-" före namnet på det underliggande indexet visar att köparen betalar räntan.

3.35.7.2 Aktieswap (två aktiedelar) som handlas på en handelsplattform utanför unionen (instrumentet är inte tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 107

Värdepappersföretag X köper en aktieswap på en handelsplattform utanför EU och därför är swappen inte tillgänglig i Esmas förteckning. Det underliggande aktieindexet innehåller finansiella instrument som är upptagna till handel på en reglerad marknad.

Handelsplattformen använder en central motpart vars LEI är CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Swapavtalets ISIN är US000DAX000X och avtalet omfattar ett teoretiskt värde på 1 000 000 euro.

Avtalet löper ut den 25 juni 2016 och avvecklas kontant.

Ett av de underliggande är DAX 30 Index (ISIN DE0008469008).

Det andra underliggande är IBEX 35 Index (ISIN ES0SI0000005).

Swapavtalets spread är "0" och de två värdepappersföretagen avtalar att företag X ska betala 1 000 euro i förskott till företag Y.

Handelsplatsens kod för aktieswappen är XUSA och handelsplatsen använder en central motpart vars LEI är CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Instrumentets fullständiga namn är ett fritt textfält som ska fyllas i av den utförande enheten: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16

Aktieswappens CFI-kod är SESPXC.

Värdepappersföretag X ska erhålla resultatet från DAX och betala resultatet från IBEX.

Hur ska värdepappersföretagen X och Y rapportera?

N	Fält	Värderapport	Värderapport
---	------	--------------	--------------

		värdepappersföretag X	värdepappersföretag Y
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för CCP
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för CCP	{LEI} för värdepappersföretag Y
30	Kvantitet	1000000	1000000
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	"EUR"
33	Pris	"0"	"0"
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XUSA"	"XUSA"
38	Förskottsbetalning	"1000"	"1000"
39	Valuta för förskottsbetalning	"EUR"	"EUR"
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN}	{ISIN}
42	Instrumentets fullständiga namn	"DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16"	"DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16"
43	Instrumentets klassificering	"SESPXC"	"SESPXC"
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	"EUR"
46	Prismultiplikator	"1"	"1"
47	Kod för underliggande instrument	"+"{DAX 30 ISIN} "- "{IBEX 35 ISIN}	"+"{DAX 30 ISIN} "- "{IBEX 35 ISIN}
48	Namn på underliggande index	"+" "DAX 30" "- " "IBEX 35"	"+" "DAX 30" "- " "IBEX 35"
55	Giltighet	"2016-06-25"	"2016-06-25"
56	Leveranstyp	"CASH"	"CASH"

XML:

Rapport från värdepappersföretag X	Rapport från värdepappersföretag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </pre>

```

<LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI>
  </Id>
  </AcctOwnr>
</Sellr>
...
<Tx>
...
  <Qty>
  <NmnlVal>
Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
  </Qty>
  <Pric>
  <Pric>
  <Pctg>0</Pctg>
  </Pric>
  </Pric>
  <TradVn>XUSA</TradVn>
  <UpFrntPmt>
  <Amt Ccy="EUR">1000</Amt>
  </UpFrntPmt>
</Tx>
<FinInstrm>
  <Othr>
  <FinInstrmGnlAttrbts>
  <Id>US000DAX000X</Id>
  <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN
16</FullNm>
  <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp>
  <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
  </FinInstrmGnlAttrbts>
  <DerivInstrmAttrbts>
  <XpryDt>2016-06-25</XpryDt>
  <PricMltplr>1</PricMltplr>
  <UndrlygInstrm>
  <Swp>
  <Swpln>
  <Sngl>
  <Indx>
  <ISIN>DE0008469008</ISIN>
  <Nm>
  <RefRate>
  <Nm>DAX 30</Nm>
  </RefRate>
  </Nm>
  </Indx>
  </Sngl>
  </Swpln>
  <SwpOut>
  <Sngl>
  <Indx>
  <ISIN>ES0SI0000005</ISIN>
  <Nm>
  <RefRate>
  <Nm>IBEX 35</Nm>
  </RefRate>
  </Nm>

```

```

  <Sellr>
  <AcctOwnr>
  <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
  </Id>
  </AcctOwnr>
</Sellr>
...
<Tx>
...
  <Qty>
  <NmnlVal>
Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
  </Qty>
  <Pric>
  <Pric>
  <Pctg>0</Pctg>
  </Pric>
  </Pric>
  <TradVn>XUSA</TradVn>
  <UpFrntPmt>
  <Amt Ccy="EUR">1000</Amt>
  </UpFrntPmt>
</Tx>
<FinInstrm>
  <Othr>
  <FinInstrmGnlAttrbts>
  <Id>US000DAX000X</Id>
  <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN
16</FullNm>
  <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp>
  <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
  </FinInstrmGnlAttrbts>
  <DerivInstrmAttrbts>
  <XpryDt>2016-06-25</XpryDt>
  <PricMltplr>1</PricMltplr>
  <UndrlygInstrm>
  <Swp>
  <Swpln>
  <Sngl>
  <Indx>
  <ISIN>DE0008469008</ISIN>
  <Nm>
  <RefRate>
  <Nm>DAX 30</Nm>
  </RefRate>
  </Nm>
  </Indx>
  </Sngl>
  </Swpln>
  <SwpOut>
  <Sngl>
  <Indx>
  <ISIN>ES0SI0000005</ISIN>
  <Nm>
  <RefRate>

```

<pre> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

Alternativt kan värdepappersföretag Y även inge en rapport som visar att det är köpare i stället för företag X. I detta fall ska tecknen i det underliggande fältet ändras i enlighet därmed, dvs. för att visa vilket (resultat från det) underliggande som köparen erhåller och vilket denne ska betala.

5.35.7.3 Aktieswap (två aktiedelar) som handlas OTC (instrumentet är inte tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 108

Värdepappersföretag X handlar en aktieswap OTC med värdepappersföretag Y. De underliggande aktierna är upptagna till handel på en handelsplats. Avtalet löper ut den 25 juni 2016 och avvecklas kontant. Swapavtalet omfattar ett teoretiskt värde på 1 000 000 euro. Någon spread betalas inte.

Den ena underliggande aktien är Orange (ISIN FR0000133308).

Den andra underliggande aktien är Telefonica (ISIN ES0178430E18).

Instrumentets fullständiga namn är ett fritt textfält som ska fyllas i av den utförande enheten: ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16. Aktieswappens CFI-kod är SESPXC.

Värdepappersföretag X ska erhålla resultatet från Orange-aktien och betala resultatet från Telefonica-aktien.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport från värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> ... <New> ... </pre>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	

16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp>
30	Kvantitet	"1000000"	
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"0"	
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	"+"{ISIN för underliggande Orange-aktie} "-"{ISIN för underliggande Telefonica-aktie}	
55	Giltighet	"2016-06-25"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			</UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	---

Hur ska värdepappersföretag Y rapportera?

N	Fält	Värderapport från värdepappersföretag Y	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag Y	<Tx> ... <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	

			<pre> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
30	Kvantitet	"1000000"	
33	Pris		
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	
47	Kod för underliggande instrument	"-{ISIN för underliggande Orange-aktie}"+ "{ISIN för underliggande Telefonica-aktie}"	
55	Giltighet	"2016-06-25"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

Alternativt kan värdepappersföretag Y även inge en rapport som visar att det är köpare i stället för företag X. I detta fall ska tecknen i det underliggande fältet ändras i enlighet därmed, dvs. för att visa vilket (resultat från det) underliggande som köparen erhåller och vilket denne ska betala.

5.35.7.4 Totalavkastningsswap som handlas OTC (instrumentet är inte tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 109

Värdepappersföretag X handlar en totalavkastningsswap OTC på Austrian Traded Index (ATX) med värdepappersföretag Y. ISIN för ATX är AT0000999982. Värdepappersföretag X betalar den fastställda ränta som definieras som 3 månaders EURIBOR plus 30 baspunkter, medan värdepappersföretag Y betalar den totala avkastningen från indexet, inbegripet både den inkomst som genereras och eventuell kapitalvinst. Värdepappersföretag Y säljer totalavkastningsswappen medan värdepappersföretag X köper swapavtalet, eftersom värdepappersföretag X drar fördel av avkastningen från den underliggande tillgången utan att fysiskt äga den i utbyte mot en fastställd betalning.

Avtalet omfattar ett teoretiskt belopp på 2 000 000 euro och löper ut den 15 december 2018.

Det sker en avtalad förskottsbetalning på 15 000 euro som värdepappersföretag X betalar till värdepappersföretag Y. CFI-koden är SEITXC och avtalet avvecklas kontant.

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	Värderapport värdepappersföretag Y
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag Y
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	{LEI} för värdepappersföretag Y
30	Kvantitet	"2000000"	"2000000"
33	Pris	"30"	"30"
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XXXX"	"XXXX"
38	Förskottsbetalning	"15000"	"15000"
39	Valuta för förskottsbetalning	"EUR"	"EUR"
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS"	"TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI + 30BPS"
43	Instrumentets klassificering	"SEITXC"	"SEITXC"
44	Teoretisk valuta	"EUR"	"EUR"
46	Prismultiplikator	"1"	"1"
47	Kod för underliggande instrument	"+"{ISIN för underliggande ATX index}	"+"{ISIN för underliggande ATX index}
48	Namn på underliggande index	"-{EURI indexnamn}"	"-{EURI indexnamn}"
49	Löptid för underliggande index	"3MNTH"	"3MNTH"
55	Giltighet	"2018-12-15"	"2018-12-15"
56	Leveranstyp	"CASH"	"CASH"

XML:

Rapport från företag X	Rapport från företag Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</Exc tgPty> </pre>

<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">15000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS</FullNm> <ClssfctnTp>SEITXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> </Swp> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> </Swp> </UndrlygInstrm> </Othr> </FinInstrm> </pre>	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">15000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS</FullNm> <ClssfctnTp>SEITXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> </Swp> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> </Swp> </UndrlygInstrm> </Othr> </FinInstrm> </pre>
---	---

<pre> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>EURI</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>MNTH</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>EURI</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>MNTH</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

5.35.7.5 Aktiekorgswap som handlas OTC (instrumentet är inte tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 110

Värdepappersföretag X ("betalare av aktiebeloppet") ingår en tvåårig aktiekorgswap OTC som avvecklas kontant den 15 juni 2018 med värdepappersföretag Y ("betalare av ränteersättningen") av ett års LIBOR på 3,7 % + 5 baspunkter. Värdepappersföretag X går med på att betala den sammanlagda avkastningen från en aktiekorg med fyra aktier (ursprungligt korgvärde: 21,85 euro) till värdepappersföretag Y. Antalet aktier som är föremål för swapavtalet är 1 000 000, vilket innebär att aktieswappen har ett teoretiskt värde på 21 850 000 euro.

Korgen består av fyra aktier, varav tre handlas på en handelsplats inom EES:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)
- Cargotec (ISIN FI0009013429)
- Intel Corporation (ISIN US4581401001)

Enligt artikel 26.2 c i MiFIR ska den amerikanska aktien i korgen inte anges i fält 47 (kod för underliggande instrument), eftersom den inte handlas på en handelsplats inom EES.

Avtalet löper ut den 15 juni 2018 och CFI-koden är SEBPXC. Avtalet avvecklas kontant.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersför etag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">218550000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>5</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018</FullNm> <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
30	Kvantitet	"21850000"	
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"5"	
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	"+""FI0009005870" " "+""FI0009014575" " "+""FI0009013429" "	
48	Namn på underliggande index	"-""LIBO"	
49	Löptid för underliggande index	"1YEAR"	
55	Giltighet	"2018-06-15"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <ISIN>FI0009013429</ISIN> </Bskt> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>YEAR</Unit> <Val>1</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

I den här situationen köper värdepappersföretag Y aktiekorgswappen eftersom det är nämnda företag som får resultatet från aktiekorgen.

3.35.7.6 Swap bestående av två korgar som handlas OTC (instrumentet är inte tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 111

Värdepappersföretag X ("betalare av resultatet från korg A") ingår en tvåårig OTC-aktiekorgswap som avvecklas kontant den 15 juli 2018 med värdepappersföretag Y ("betalare av resultatet från korg B"). Värdepappersföretag X går med på att betala det sammanlagda resultatet från aktiekorg A på förfallodagen och värdepappersföretag Y går med på att betala det sammanlagda resultatet från aktiekorg B på förfallodagen. Aktieswappens teoretiska värde är 10 000 000 euro.

Aktiekorg A innehåller två aktier (som handlas på en handelsplats) och har ett referensvärde på 16,10 euro:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)

Aktiekorg B innehåller två aktier (som handlas på en handelsplats) och har ett referensvärde på 40,85 SEK:

- Elisa (ISIN FI0009007884)

- TeliaSonera (ISIN SE0000667925)

Swapavtalet löper ut den 15 juli 2018 och CFI-koden är SEBPXC.

Swapavtalets spread är "0".

De transaktionsrapporter som visas nedan är enbart ur värdepappersföretag X:s perspektiv.

N	Fält	Värderapport från värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">10000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018</FullNm> <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
30	Kvantitet	"10000000"	
31	Kvantitetsvaluta	"EUR"	
33	Pris	"0"	
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
44	Teoretisk valuta 1	"EUR"	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	"+"FI0009007884 "+"SE0000667925 "- "FI0009005870 "- ""FI0009014575"	
55	Giltighet	"2018-07-15"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-07-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Bskt> <ISIN>FI0009007884</ISIN> <ISIN>SE0000667925</ISIN> </Bskt> </Swpln> <SwpOut> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN> </Bskt> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Om värdepappersföretag Y ingav en rapport som visar att det är köpare i stället för företag X bör tecknen i det underliggande fältet ändras i enlighet därmed, dvs. för att visa vilket (resultat från det) underliggande som köparen erhåller och vilket denne ska betala.

5.35.7.7 Ränteswap av typen "plain-vanilla" som handlas på en handelsplats (instrumentet är tillgängligt i Esmas förteckning)

Exempel 112

Värdepappersföretag X köper en vanilla ränteswap (ISIN XS0000000003) från värdepappersföretag Y till ett teoretiskt belopp av 100 000 000 GBP på handelsplats M. Swappen löper ut den 21 oktober 2025. För enkelhetens skull antar vi att swapavtalets spread är noll.

Värdepappersföretag X betalar 1,8655 %, halvårsvis (Act/365F), medan värdepappersföretag Y betalar 6-månaders GBP-LIBOR, halvårsvis (Act/365F).

Swapavtalets spread är "0".

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

Priset som rapporteras i fält 33 ska stämma överens med värdet för den fasta räntan avseende instrumentets referensuppgifter.

N	Fält	Värderapport	XML
---	------	--------------	-----

värdepappersför etag X			
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="GBP">100000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS0000000003</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag Y	
30	Kvantitet	"100000000"	
31	Kvantitetsvaluta	"GBP"	
33	Pris	"0"	
34	Prisvaluta		
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplats M	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för instrumentet	

5.35.8 Råvarubaserade derivat

5.35.8.1 Option som handlas OTC på en börshandlad råvarutermin

Exempel 113

Värdepappersföretag X köper 100 amerikanska "up-and-in" barriärköpoptioner på terminsavtal för majs. Lösenpriset är 168 euro och förfallodag är den 30 augusti 2018. Ett optionsavtal ger köparen rätt till ett terminsavtal för majs.

Den betalda premien uppgår till 0,95 euro.

Det underliggande instrumentet för barriäroptionsavtalet är ett terminsavtal som handlas på Euronext Paris för 170 euro.

Handelsenheten för terminsavtalet är 50 ton och avtalets ISIN är FR0000000000.

Barriären är placerad vid 172 euro (optionsavtalet får effekt enbart om priset på det underliggande terminsavtalet når barriären).

Barriäroptionens CFI-kod är HTFBBC och avvecklas kontant.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport från värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">0.95</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>UP AND IN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORN FUTURES CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>HTFBBC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> </pre>
30	Kvantitet	"100"	
33	Pris	"0,95"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORNFUTURES CONTRACT"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"1"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN för majsterminen}	
50	Optionsslag	"CALL"	
51	Lösenpris	"168"	
52	Lösenprisvaluta	"EUR"	
53	Typ av optionsinlösen	"AMER"	
55	Giltighet	"2018-08-30"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <XpryDt>2018-08-30</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>FR0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">168</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>AMER</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Barriäroptionens underliggande instrument är majsterminsavtalet och därför ska identifieringskoden för majsterminsavtalet Euronext anges i fält 47.

Barriäroptionen beskrivs i fälten avseende instrumentets referensuppgifter i transaktionsrapporten.

5.35.8.2 Utsläppsrättskontrakt

Exempel 114

Värdepappersföretag X köper 3 000 EU-utsläppsrätter för 7,50 euro på den reglerade marknaden European Energy Exchange (MIC XEEE).

Instrumentets ISIN är DE000A1DKQ99.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</Ex ctgPty> ... </pre>
30	Kvantitet	"3000"	
33	Pris	"7,50"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för handelsplatsen	

41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN} för utsläppsrättskontraktet }	<pre> <Tx> ... <Qty> <Unit>3000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.50</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A1DKQ99</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
----	---------------------------------	--------------------------------------	---

5.35.8.3 Terminsavtal om utsläppsrätter

Exempel 115

Värdepappersföretag X köper 5 terminsavtal om EU-utsläppsrätter (ett terminsavtal representerar 1 000 EU-koldioxidutsläppsrätter) för 7,90 euro på den reglerade marknaden European Energy Exchange (MIC XEEE).

ISIN för terminsavtalet om utsläppsrätter är DE000A0SYVA6.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.90</Amt> </MntryVal> </Pric> </pre>
30	Kvantitet	"5"	
33	Pris	"7,90"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats	
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN för terminsavtalet}	

			</Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A0SYVA6</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	---

5.35.8.4 Option som handlas OTC på ett börshandlat terminsavtal om utsläppsrätter

Exempel 116

Värdepappersföretag X köper 5 köpoptioner OTC av europeiskt snitt på ett börshandlat terminsavtal om utsläppsrätter. Den betalda premien uppgår till 1,00 euro och optionsavtalet löper ut den 31 december 2018. Denna option handlas inte på en handelsplats och har inte någon ISIN-kod.

Prismultiplikatorn (antalet terminer som är representerade i ett avtal) är 10, medan lösenpriset (pris till vilket terminen köps eller säljs när optionen löses in) är 8,00 euro.

Terminen på utsläppsrätter handlas på den reglerade marknaden European Energy Exchange (MIC XEEE) och ISIN-koden är DE000A0SYVA6.

CFI-koden för köpoptionen är HTFAVC och avtalet avvecklas kontant.

Hur ska värdepappersföretag X rapportera?

N	Fält	Värderapport värdepappersföretag X	XML
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm>
30	Kvantitet	"5"	
33	Pris	"1,00"	
34	Prisvaluta	"EUR"	
36	Handelsplats	"XXXX"	
41	Instrumentets identifieringskod		
42	Instrumentets fullständiga namn	"XXX CALL OPTION"	
43	Instrumentets klassificering	{CFI-kod}	
46	Prismultiplikator	"10"	
47	Kod för underliggande instrument	{ISIN} för underliggande terminsavtal	
50	Optionsslag	"CALL"	
51	Lösenpris	"8,00"	
52	Lösenprisvaluta	"EUR"	
53	Typ av optionsinlösen	"EURO"	
55	Giltighet	"2018-12-31"	
56	Leveranstyp	"CASH"	

			<pre> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullINm>XXX CALL OPTION</FullINm> <ClssfctnTp>HTFAVC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>10</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE000A0SYVA6</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">8.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Det underliggande instrumentet för köptionen är terminsavtalet om utsläppsrätter och därför ska terminsavtalets ISIN anges i fält 47.

5.35.9 Komplex handel

Artikel 12 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 är enbart tillämplig när ett värdepappersföretag utför en transaktion som omfattar två eller flera finansiella instrument (dvs. komplex handel). Vad gäller transaktionsrapporteringen betyder detta att transaktionen endast ska anses omfatta två eller flera finansiella instrument när det är fråga om en enda transaktion som äger rum samtidigt i flera finansiella instrument för ett enda pris (t.ex. köp av ett "short butterfly-avtal", som består av tre olika köptioner). Alla fält som inte visas i exemplet ska fyllas i för den komplexa handeln (t.ex. strategier och strukturerade produkter) och inte för de faktiska delarna.

Exempel 117

Värdepappersföretag X vill skapa en "short butterfly"-strategi som består av två sälloptioner för 1 075 finansiella instrument och en köpoption för 2 150 finansiella instrument. Det ger in dessa två säljorder och köpordern till handelssystemet Eurex där de genomförs som en strategitransaktion med ett enda pris.

N	Fält	Värden Rapport #1	Värden Rapport #2	Värden Rapport #3
2	Transaktionens referensnummer	89127	89128	89129
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP	{LEI} för företag X	{LEI} för CCP
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för CCP	{LEI} för värdepappersföretag X
30	Kvantitet	"1075"	"2150"	"1075"
33	Pris	"40"	"40"	"40"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats
40	Komponent-id för komplex handel	"12345"	"12345"	"12345"

XML:

Rapport #1	Rapport #2	Rapport #3
<pre> <Tx> <New> <TxId>89127</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>89128</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>89129</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>

<pre> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> ... <Qty> <Unit>2150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Exempel 118

Värdepappersföretag X säljer 10 Bund-terminer på Eurex Bonds (XEUR) och köper samtidigt ett motsvarande antal av de underliggande tyska statsobligationerna. Dessa transaktionsled är del av en strategisk transaktion (basis trade) och handlas för ett enda pris på 20 euro.

ISIN-koden för obligationsterminen är DE0000000000 och den underliggande obligationens ISIN-kod är DE0000000001.

Denna transaktion ska rapporteras i två separata transaktionsrapporter som var och en speglar transaktionen för ett av de finansiella instrument som strategin består av. Båda transaktionsrapporterna ska vara sammankopplade genom en intern kod som ska anges i fält 40, som är unik för de transaktionsrapporter som avser samma strategi.

De transaktionsrapporter som visas nedan är enbart ur värdepappersföretag X:s perspektiv.

N	Fält	Värderapport #1	Värderapport #2
4	Identifieringskod för den utförande enheten	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för värdepappersföretag X
7	Köparens identifieringskod	{LEI} för CCP	{LEI} för värdepappersföretag X
16	Säljarens identifieringskod	{LEI} för värdepappersföretag X	{LEI} för CCP
30	Kvantitet	"10"	"1000000"
33	Pris	"20"	"20"
34	Prisvaluta	"EUR"	"EUR"
36	Handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats	{MIC}-segment för en handelsplats

40	Komponent-id för komplex handel	"12345"	"12345"
41	Instrumentets identifieringskod	{ISIN för obligationsterminsavtalet}	{Obligationens ISIN}

XML:

Rapport #1	Rapport #2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> < <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">20</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000000</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> < <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>1000000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">20</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE00000000001</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>

6 Riktlinjer för registerföring av order

Del I – Allmänna principer

6.1 Tillämpningsområde för kraven på registerföring av order

Enligt artikel 25.2 är kraven på registerföring av order tillämpliga på marknadsplatsoperatörer av handelsplatser med avseende på "samtliga order som avser finansiella instrument och visas genom deras system".

De är tillämpliga med avseende på "order", vilket omfattar de som är aktiva, inaktiva, stoppade, implicita och omdirigerade samt ändring, annullering och avslag av order. De är vidare tillämpliga på fasta och vägledande bud.

6.2 Medlemmar eller deltagare i en handelsplats

I MiFID II och MiFIR finns det flera bestämmelser där det hänvisas till en "medlem eller deltagare" i en handelsplats. Betydelsen av "handelsplats" definieras i artikel 4.1.24 i MiFID II och omfattar reglerade marknader, MTF-plattformar och OTF-plattformar. Det finns emellertid behov av mer klarhet vad gäller betydelsen av "medlem eller deltagare" i en handelsplats i den mening som avses i artikel 50 i MiFID II och artikel 25.2 i MiFIR.

Begreppen "medlem" och "deltagare" används allmänt i samband med reglerade marknader och MTF-plattformar. I skäl 16 i MiFID II klargörs att "[p]ersoner som har tillträde till reglerade marknader eller MTF-plattformar hänvisas till som medlemmar eller deltagare. Båda beteckningarna kan användas utan åtskillnad. [...]"

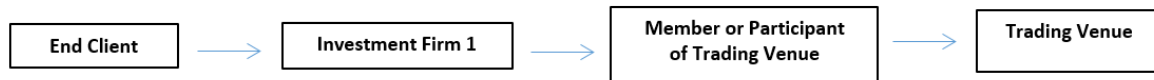
Emellertid används en annan metod för OTF-plattformar som speglar den omständigheten att skyldigheterna gentemot kunden enligt MiFID är tillämpliga på operatörer av OTF-plattformar, till skillnad från operatörer av MTF-plattformar och reglerade marknader. Till exempel föreskrivs i artikel 18.7 i MiFID II att MTF-plattformar och OTF-plattformar ska ha "åtminstone tre väsentligen aktiva medlemmar eller användare". Samtidigt innehåller artikel 20 i MiFID II ett förbud mot att en OTF-plattform utför kundorder med utnyttjande av sitt eget kapital. I båda situationerna förefaller det som om begreppen "användare" och "kund" används synonymt vid hänvisning till en OTF-plattform, och att de är analoga med begreppen "medlem" och "deltagare".

Eftersom OTF-plattformar omfattas av tillämpningsområdet för förordningen om marknadsmissbruk, och mot bakgrund av behovet av en enhetlig tillämpning av kraven i MiFID II/MiFIR på olika typer av handelsplatser, ska begreppen "medlem eller deltagare" i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 (registrering av orderdata) och kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 (synkronisering av klockor) anses omfatta kunder eller användare av OTF-plattformar.

6.3 Identifieringskod för kund (fält 3)

Identifieringskod för kund (fält 3) används för att identifiera medlemmens eller deltagarens kund. Endast LEI eller {NATIONAL_ID}, i förekommande fall, för medlemmens eller deltagarens direkta kund på handelsplatsen ska anges i fält 3. Skyldigheten att bibehålla identifieringskoden för kund (fält 3) kräver

varken att handelsplatser registrerar slutkundens kund-id eller något annat kund-id från förmedlare i kedjan från medlemmens eller deltagarens direkta kund till slutkunden. Flödesschemat nedan illustrerar förklaringen ovan; värdepappersföretag 1 är kund till handelsplatsens medlem eller deltagare.



End client	Slutkund
Investment Firm 1	Värdepappersföretag 1
Member of Participant of Trading Venue	Medlem eller deltagare i handelsplatsen
Trading Venue	Handelsplats

Operatörer av handelsplatser ska begära identifieringskoden för dess medlems eller deltagares direkta kund och ange detta kund-id i fält 3.

Om detta kund-id inte har samlats in när ordern inges till handelsplatsoperatören ska operatören erhålla det kund-id som saknas så snart som möjligt och inte senare än vid slutet av den arbetsdag som följer efter ingivandet av ordern.

För kunder ska handelsplatsen kontrollera att den identifieringskod som tillhandahålls inte innehåller uppenbara fel eller utelämnad information.

6.3.1 Ifyllande av fält 3 (identifieringskod för kund) vid ackumulerade order

När tilldelningen har ägt rum och kunderna identifieras, innan ordern vidarebefordras till handelsplatsens medlem eller deltagare för utförande, och order från flera kunder ackumuleras av handelsplatsens medlem eller deltagare, ska handelsplatsoperatören ange standardreferensen "AGGR" i fält 3.

6.3.2 Ifyllande av fält 3 (identifieringskod för kund) i avvaktan på tilldelning

I det undantagsfall där tilldelningen ännu inte har gjorts vid tidpunkten för ingivandet av ordern, och när den tillämpliga nationella lagstiftningen medger att tilldelningen av ordern äger rum efter ingivandet, ska handelsplatsoperatören för en sådan order ange standardreferensen "PNAL" i fält 3. Relevant handelsplatsoperatör är inte skyldig att därefter spåra detta kund-id vid tilldelningen av order till de enskilda kunderna.

6.4 Icke-verkställande mäklare (fält 6)

Verksamheten hos en icke-verkställande mäklare skiljer sig från direkt elektroniskt tillträde (DEA) såsom definieras i artikel 4.1.41 i MiFID II. Enligt artikel 2.1 d i kommissionens delegerade förordning (EU)

2017/580, tillsammans med fält 6, föreskrivs att denna tjänst uppkommer när en medlem eller deltagare i en handelsplats (den icke-verkställande mäklaren) dirigerar en order till handelsplatsen för en annan medlems eller deltagares räkning och i dennes namn.

Exempel 119

Värdepappersföretag X lägger en order för genomförande till handelsplats M genom den icke-verkställande mäklaren värdepappersföretag Y för kund Z:s räkning.

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna				
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	LEI för värdepappersföretag X som är medlem i handelsplats M		
2	Direkt elektronisk åtkomst (DEA)	FALSE		
3	Identifieringskod för kund	NATIONELLT ID för den fysiska personen Z		
6	Icke-verkställande mäklare	LEI för värdepappersföretag Y		
Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet				
7	Handelskapacitet	AOTC		Värdepappersföretag X handlar för kund Z:s räkning.

6.5 Orderstatus (fält 33)

Orderstatusen ska inte fyllas i vid annullering, avslag, utgång och helt utförda händelser eftersom de inte längre förekommer i handelsplatsens orderbok.

6.6 Giltighetsperiod och tidpunkt (fält 12)

- Vad gäller order av typen "genomför genast eller annullera" (Immediate-or-Cancel) eller "allt eller makulera" (Fill-or-Kill) ska fält 12 (giltighetsperiod och tidpunkt) inte fyllas i (se fält 10 – giltighetsperiod). Detta beror på att dessa typer av order är avsedda att utföras direkt när de ges in till orderboken (antingen fullständigt för allt eller makulera-order eller till den maximala kvantiteten vad gäller genomför genast eller annullera-order).
- Vad beträffar kategorin "annat" gäller hänvisningen till datum och tidsstämplar för "ytterligare" typer av giltighetsperioder varje annan typ av giltighetsperiod som inte anges särskilt i fält 10 (giltighetsperiod). I detta fall ska en unik kod på fyra bokstäver anges i fält 10 som representerar den särskilda typen av giltighetsperiod och fält 12 ska fyllas i.

6.7 Indikator för passiv eller aggressiv (fält 44)

Detta fält ska endast fyllas i vid utföranden som äger rum under den aktuella börsdagen, i annat fall ska det lämnas tomt. Detta beror på att en order varken skulle vara passiv eller aggressiv under auktionsperioder.

6.8 Identifieringskod för handelsplatstransaktioner (fält 48)

Enligt artikel 12 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 ska handelsplatsoperatörer bibehålla en individuell "identifieringskod för handelsplatstransaktioner" för varje transaktion som är ett resultat av ett helt eller delvist genomförande av en order såsom specificeras i fält 48.

Således ska handelsplatsoperatörer alltid generera en "identifieringskod för handelsplatstransaktioner" för varje transaktion som genomförs på deras handelsplats och som uppkommer från en order i ett finansiellt instrument som visas genom deras system. Om ovannämnda omständigheter föreligger ska operatören av handelsplatsen följaktligen rapportera den relevanta koden genom att fylla i fält 48.

6.9 Ordningsnummer (fält 15)

Ordningsnumret används för att fastställa vilken händelse som inträffade först på en handelsplats när två händelser har samma tidsstämpel. Handelsplatserna ska säkerställa att var och en av de särskilda händelser som anges i fält 21, i kolumnerna för innehåll och format, tilldelas ett ordningsnummer. Handelsfaser som anges i avsnitt 6.13.9 omfattas av händelsen "statusförändring genom marknadsoperationer" som anges i fält 21. Därför ska handelsplatserna ange ordningsnumret för förändringar i handelsfaserna.

Vissa handelsplatser kan använda flera matchningsmekanismer för att balansera belastningen i systemen. I detta fall ska ordningsnumret vara unikt för varje händelse och konsekvent för alla händelser på matchningsmekanismen.

Följande exempel tillhandahålls:

1. Felaktig användning när ordningsnumret endast är specifikt för den enskilda orderboken.
2. Felaktig användning när ordningsnumret förefaller vara unikt per order.
3. Korrekt användning av ordningsnumret.

Vad gäller exemplen 77 och 78 nedan innehåller den enskilda matchningsmekanismen på handelsplatsen mer än en orderbok och flera händelser inträffar i båda orderböckerna.

Exempel 120: Felaktig användning när ordningsnumret endast är specifikt för den enskilda orderboken

Här förefaller ordningsnumret endast vara specifikt för den enskilda orderboken. Detta är inte godtagbart eftersom det innebär att de behöriga myndigheterna inte kan konsolidera händelser som inträffar i multipla orderböcker på samma matchningsmekanism, till exempel konsolidering av händelser i samma finansiella instrument i transparenta och icke-transparenta böcker.

De korrekta ordningsnumren ska vara 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7.

Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande (fält 21)	Orderboks-kod (fält 17)	Identifieringskod för ordern (fält 20)	Ordningsnummer (fält 15)	Datum och tid
NEWO	Orderbok 1	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z
NEWO	Orderbok 2	GHI	1	2018-03-07T08:30:26.548936Z
CHME	Orderbok 1	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z
NEWO	Orderbok 2	TUV	2	2018-03-07T08:30:26.598731Z
NEWO	Orderbok 1	DEF	3	2018-03-07T08:30:26.975621Z
CAME	Orderbok 1	ABC	4	2018-03-07T08:30:27.025489Z
CAME	Orderbok 1	DEF	5	2018-03-07T08:30:27.025489Z

Exempel 121: Felaktig användning när ordningsnumret förefaller vara unikt per order

Här förefaller ordningsnumret vara unikt per order, snarare än per matchningsmekanism.

De korrekta ordningsnumren ska vara 1, 2, 3, 4, 5.

Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande (fält 21)	Identifieringskod för ordern (fält 20)	Ordningsnummer (fält 15)	Datum och tid (fält 9)	Kommentar
NEWO	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Ordningsnumret är endast specifikt för ordern vilket innebär att varje orderhändelse för den ordern ökar ordningsnumret. Detta är inte korrekt eftersom ordningsnumret ska vara unikt för varje händelse och konsekvent för alla händelser.

CHME	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z	
NEWO	DEF	1	2018-03-07T08:30:26.975621Z	Eftersom detta är en annan order börjar ordningsnumret om på ett.
CAME	ABC	3	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	2	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Tidsstämpeln är samma som för föregående händelse. Om behöriga myndigheter emellertid sorterade ordningsnumren i stigande ordning skulle det ge intryck av att denna händelse inträffade innan händelsen, direkt före, men så är inte fallet.

Exempel 122: Korrekt användning av ordningsnummer

I detta exempel antas alla händelser äga rum i samma orderbok och handelsplatsen har en matchningsmekanism.

Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande (fält 21)	Identifieringskod för ordern (fält 20)	Ordningsnummer (fält 15)	Datum och tid (fält 9)	Kommentar
NEWO	ABC	25897	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Ordningsnumret genereras genom alla handelsplatsens orderböcker. Därför kan ordningsnumret öka med mer än ett, om händelser i en enda orderbok betraktas.
CHME	ABC	26589	2018-03-07T08:30:26.598721Z	Ordningsnumret har ökat med mer än ett eftersom matchningsmekanismen har behandlat andra händelser i andra orderböcker, men det är

				fortfarande ett unikt, positivt heltal i stigande ordning.
NEWO	DEF	26751	2018-03-07T08:30:26.975621Z	
CAME	ABC	27465	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	27466	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Tidsstämpeln är samma som för föregående händelse. Emellertid gör ordningsnumret det möjligt för behöriga myndigheter att fastställa att denna händelse inträffade efter händelsen i raden ovanför.

6.10 Giltighetsperiod (fält 10)

6.10.1 Giltig-under-dagen-flaggning (DAVY)

Exempel 123

Värdepappersföretag X inger en order för genomförande på handelsplats M med giltig-under-dagen-flaggning (DAVY) den 16 januari 2018.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
10	Giltighetsperiod	DAVY
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	2018-01-16T23:59:59.999999Z

6.10.2 Kombination av flaggor för två giltighetsperioder: Giltig efter tidpunkt (GADV) och giltig till datum (GTDV)

Exempel 124

Värdepappersföretag X inger en order för genomförande på handelsplats M med flaggorna giltig efter tidpunkt (GADV) och giltig till datum (GTDV) den 16 januari 2018 klockan 10:05:32.278932(UTC). Vid ingivandet ska giltighetsperioden vara GADV och giltighetsperiod och tidpunkt ska vara den 19 januari 2018 med tiden registrerad som 00:00:00 (med den bråkdels sekund som ska registreras enligt artikel 50 i MiFID II) eller för handelsstarten på den handelsplatsen (händelse 1). Den 19 januari 2018 ska

giltighetsperioden vara GTDV och datum och tidpunkt för giltighetsperioden ska vara den 13 februari 2018 med tiden registrerad som 23:59:59 (med den bråkdels sekund som ska registreras enligt artikel 50 i MiFID II) (händelse 2).

Händelse 1: Ingivande av ordern för genomförande

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid		2018-01-16T10:05:32.278932Z
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar			
10	Giltighetsperiod		GADV
12	Giltighetsperiod och tidpunkt		2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁴
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande		NEWO
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus		INAC ³⁵

Händelse 2: Ordern blir aktiv

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid		2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁶
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar			
10	Giltighetsperiod		GTDV
12	Giltighetsperiod och tidpunkt		2018-02-13T23:59:59.999999Z
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande		CHMO ³⁷
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus		ACTI

³⁴ Eller infoga en annan tidsstämpel innan handeln och/eller auktionen inleds.

³⁵ Vid ingivandet av ordern till handelsplatsen är ordern inaktiv på grund av giltighetsperioden för GADV:n.

³⁶ Eller infoga en annan tidsstämpel innan handeln och/eller auktionen inleds.

³⁷ Aktiveringen av ordern anses utgöra en statusförändring genom marknadsoperationer.

6.11 Tillhandahållande av likviditet (fält 8)

Tillhandahållande av likviditet genom medlemmar eller deltagare i en handelsplats äger normalt rum i ett av följande tre scenarier:

- a) En medlem eller deltagare som bedriver algoritmisk handel som ett led i en marknadsgarantstrategi och, som en följd, ingår ett avtal med en handelsplats enligt artikel 17 och artikel 48 i MiFID II.
- b) En medlem eller deltagare som tillhandahåller likviditet (som inte omfattas av en marknadsgarantstrategi enligt artikel 17 i MiFID II) handlar för egen räkning enligt ett avtal med emittenten eller handelsplatsen.
- c) En medlem eller deltagare som tillhandahåller likviditet utför order för kunders räkning enligt ett avtal med emittenten eller handelsplatsen.

De verksamheter för tillhandahållande av likviditet som anges i a) till c) ska återspeglas i handelsplatsens register genom att fält 7 (handelskapacitet), fält 8 (tillhandahållande av likviditet) och fält 3 (identifieringskod för kund) fylls i på ett korrekt sätt vid utförande av order för kundernas räkning.

Exempel 125

Scenario	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Verksamhet enligt a)	Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet	
	7. Handelskapacitet	DEAL
	8. Tillhandahållande av likviditet	true
Verksamhet enligt b)	Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet	
	7. Handelskapacitet	DEAL
	8. Tillhandahållande av likviditet	true
Verksamhet enligt c)	Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna	
	3. Identifieringskod för kund	{LEI} eller {NATIONAL_ID}
	Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet	
	7. Handelskapacitet	AOTC

	8. Tillhandahållande av likviditet	true
--	------------------------------------	------

Del II – Scenarier

6.12 Förklaring

Om inget annat anges i det särskilda scenariot är följande bakgrundsinformation tillämplig på alla scenarier som fastställs i del II:

Värdepappersföretag X (LEI: 12345678901234567890) är medlem eller deltagare i handelsplats M.

Värdepappersföretag Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) är också medlem eller deltagare i handelsplats M.

Handelsplats M:s MIC-segment är "XMIC".

Handelsplats M har en latenstid från gateway till gateway på mindre än 1 millisekund.

Det finansiella instrumentet har följande ISIN: XX0000000000

Ordern har följande identifieringskod: 123456789ABC

Orderbokskoden på handelsplats M är: XYZ9876

Handelsplats M har genererat följande identifieringskod för handelsplatstransaktioner: ABC123456

Dessutom är alla fält i tabellen med fält i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 obligatoriska. Fält ska endast lämnas tomma om de inte är relevanta för den specifika händelsen. Till exempel är fält 14, prioriterad storlek, inte relevant för en orderbok med prioritet för pris-tid och behöver inte fyllas i. Typexemplen fokuserar enbart på de fält som kräver klargörande. Oberoende av i vilket tekniskt schema uppgifterna tillhandahålls (t.ex. XML, CSV etc.) ska, om ett fält kan lämnas tomt, informationen tillhandahållas på ett sådant sätt att de behöriga myndigheterna kan fastställa att detta fält har lämnats tomt.

6.13 Central orderbok för limiterade order

Riktlinjerna för centrala orderböcker för limiterade order omfattar följande scenarier:

- Underavsnitt 6.14.1: Ny/annullering/modifiering av order
- Underavsnitt 6.14.2: Ytterligare gränspris
- Underavsnitt 6.14.3: Klassificering av en limiterad isbergsorder (iceberg order)

- d) Underavsnitt 6.14.4: Peggade order
- e) Underavsnitt 6.14.5: Klassificering av en stopporder
- f) Underavsnitt 6.14.6: Dirigerade order
- g) Underavsnitt 6.14.7: Klassificering av strategiska order
- h) Underavsnitt 6.14.8: Ändrad prioritet
- i) Underavsnitt 6.14.9: Handelsfaser

6.13.1 Ny/annullering/modifiering av order (fält 21)

6.13.1.1 Mottagande av en ny order

Även om ordern utförs när den förs in i orderboken ska den första händelsen rapporteras som "ny order".

Exempel 126

Värdepappersföretag X inger en limiterad köporder (förvärv av 1 000 aktier av det finansiella instrumentet för 80,00 euro) till handelsplats M den 16 januari 2018. Handelsplats M:s matchningsmekanism erhåller informationen klockan 08:05:32.278932(UTC).

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid		2018-01-16T08:05:32.278932Z
Avsnitt F – Orderns identifieringskod			
16	MIC-kod för segment		XMIC
17	Orderbokskod		XYZ9876
18	Identifieringskod för finansiella instrument		XX0000000000
19	Datum för mottagande		2018-01-16
20	Identifieringskod för ordern		123456789ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande		NEWO
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp		Gräns
23	Klassificering av ordertyp		LMTO
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris		80,00
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator		BUYI
36	Ursprunglig kvantitet		1000

37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	1000
38	Visad kvantitet	1000
39	Handlad kvantitet	0

6.13.1.2 Ordermodifiering av en medlem eller deltagare

Exempel 127

Värdepappersföretag X inger en modifiering av priset (ändrar till 81,00 euro) för ovannämnda order till handelsplats M (köp av 1 000 aktier med ISIN XX0000000000 för 80,00 euro) den 16 januari 2018. Handelsplats M:s matchningsmekanism erhåller begäran om modifiering klockan 14:47:55.179524(UTC). Ordermodifieringen begärdes av värdepappersföretag X:s kund.

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid			
9		Datum och tid	2018-01-16T14:47:55.179524Z
Avsnitt F – Orderns identifieringskod			
20		Identifieringskod för ordern	123456789ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21		Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	REME
Avsnitt H – Ordertyp			
22		Ordertyp	Gräns
23		Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser			
24		Gränspris	81,00
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32		Köp/sälj-indikator	BUYI
36		Ursprunglig kvantitet	1000
37		Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	1000
38		Visad kvantitet	1000
39		Handlad kvantitet	0

6.13.1.3 Delvis fylld order

Exempel 128

Den modifierade ordern avseende 1 000 aktier med ISIN XX0000000000 för 81,00 euro (se underavsnitt ovan) fylls delvis (200 aktier med ISIN XX0000000000 för 81,00 euro) samma dag, dvs. den 16 januari 2018 klockan 14:48:11.544378(UTC).

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
---	--	------	---

Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-01-16T14:48:11.544378Z
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	PARF
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränspris	81,00
28	Transaktionspris	81,00
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	BUYI
36	Ursprunglig kvantitet	1000
37	Kvarvarande kvantitet	800
38	Visad kvantitet	800
39	Handlad kvantitet	200
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	ABC123456

6.13.1.4 Helt fylld order

Exempel 129

Den kvarvarande kvantiteten på 800 aktier med ISIN XX0000000000 för 81,00 euro (se underavsnitt ovan) från den delvis fyllda ordern fylls sedan i sin helhet (800 aktier med ISIN XX0000000000 för 81,00 euro) samma dag, dvs. den 16 januari 2018 klockan 14: 50:20.379545(UTC).

Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		
N	Fält	
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-01-16T14: 50:20.379545Z
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	FILL
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränspris	81,00
28	Transaktionspris	81,00
Avsnitt J – Orderinstruktioner		

32	Köp/sälj-indikator	BUYI
36	Ursprunglig kvantitet	1000
37	Kvarvarande kvantitet	0
38	Visad kvantitet	0
39	Handlad kvantitet	800
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	ABC789000

6.13.1.5 Annullerad order

Exempel 130

Värdepappersföretag X inger en begäran om annullering av en säljorder avseende 2 000 aktier med ISIN XX0000000000 för 50,00 euro till handelsplats M den 18 januari 2018 klockan 14:12:34(UTC). Handelsplats M:s matchningsmekanism erhåller begäran om annullering klockan 14:12:34.112856(UTC). Annulleringen av ordern begärdes av värdepappersföretag X:s kund.

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid			
9		Datum och tid	2018-01-18T14:12:34.112856Z
Avsnitt F – Orderns identifieringskod			
20		Identifieringskod för ordern	987654321ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21		Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	CAME
Avsnitt H – Ordertyp			
22		Ordertyp	Gräns
23		Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser			
24		Gränspris	50,00
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32		Köp/sälj-indikator	SELL
33		Orderstatus ³⁸	
36		Ursprunglig kvantitet	2000
37		Kvarvarande kvantitet	0
38		Visad kvantitet	0
39		Handlad kvantitet	0

6.13.2 Ytterligare gränspris (fält 25)

Exempel 131

³⁸ Denna ska vara tom i enlighet med avsnitt 6.5.

Värdepappersföretag M erbjuder en funktion under slutauktionen där en limiterad order kan föras in med ett gränsspris som är det högsta priset för att köpa eller det lägsta priset för att sälja, och möjligheten till ett ytterligare gränsspris vilket är det lägsta priset för att köpa eller det högsta priset för att sälja. På handelsplats M behandlas denna typ av order som en aktiv order oberoende av huruvida priset för värdepappret ligger utanför de lägsta eller de högsta priserna. En köporder inges till handelsplats M med ett högsta pris för att köpa på 100 euro och ett ytterligare lägsta gränsspris för att köpa på 95 euro.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt H – Ordertyp				
22	Ordertyp	Strike match	Enligt handelsplatsens egen specifiering.	
23	Klassificering av ordertyp	LMTO		
Avsnitt I – Priser				
24	Gränsspris	100		
25	Ytterligare gränsspris	95		
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
32	Köp/sälj-indikator	BUYI		
33	Orderstatus	ACTI	Ordern är aktiv för slutauktionen men genomförs endast om jämviktspriset ligger mellan 95 och 100 euro.	

6.13.3 Klassificering av en limiterad isbergsorder

Exempel 132

Den 7 mars 2018 klockan 10:10:32.652758(UTC) inger värdepappersföretag X en limiterad isbergsorder för köp till handelsplats M. Ordern avser förvärv av totalt 150 aktier för 100,00 euro. Isbergsordern är utformad så att en kvantitet på 50 aktier visas i orderboken medan 100 aktier är gömda för marknadsaktörerna (händelse 1).

Fjorton sekunder efter ingivandet i handelsplats M:s orderbok genomförs isbergsordern för hela den visade kvantiteten (50 aktier) (händelse 2).

Efter det delvisa genomförandet av isbergsordern fylls den visade kvantiteten genast på. I denna situation adderas tre mikrosekunder för handelsplats M för att spegla en liten latens i handelsplatsens system (händelse 3).

Händelse 1: Ordern inges i orderboken.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	2	Enligt handelsplats M:s egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	100,00	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	150	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	150	
38	Visad kvantitet	50	

Händelse 2: Isbergsordern genomförs för hela den visade kvantiteten.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:46.652785Z	Handeln äger rum 14 sekunder efter att den införts i orderboken	

Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:32.652785Z	Ingen ändring.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	PARF	Ordern är delvis fylld.
Avsnitt I – Priser			
28	Transaktionspris	100,00	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	150	Ingen ändring.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100	
38	Visad kvantitet	0	Påfyllnaden av den visade kvantiteten ska återspeglas vid nästa händelse.
39	Handlad kvantitet	50	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	ABC123456	

Händelse 3: Påfyllnad av den visade kvantiteten av isbergsordern.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:46.652788Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:46.652788Z	Vid påfyllnaden får en isbergsorder en ny prioritetstidsstämpel (dvs. datum och tid för påfyllningen).
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt	REMA	Ersatt av marknadsoperationer (automatiska).

	eller delvist genomförande		
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	150	<i>Ingen ändring.</i>
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100	<i>Ingen ändring.</i>
38	Visad kvantitet	50	

6.13.4 Peggade order³⁹

Exempel 133

Den 7 mars 2018 klockan 10:10:32.652785(UTC) inger värdepappersföretaget en peggad köporder för genomförande på handelsplats M. Vid ingivandet av ordern specificerar handlaren följande:

- Kvantiteten motsvarar 150 utan några dolda kvantiteter.
- Ordern är peggad till det bästa budet på handelsplatsen.
- Ordern är fastställd för att pegga anbudspriset upp till 100,10 (dvs. om anbudspriset är högre än 100,10 euro förblir den peggade ordern vid gränsen på 100,10 euro).

Handelsplats M hanterar den peggade ordern på följande sätt:

Orden rankas med lägst prioritet.

Ordern peggas till det bästa anbudspriset med en latens på 50 ms⁴⁰.

Orderbokens status⁴¹ innan ordern inges till handelsplats M

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

³⁹ I den mening som avses i detta exempel är en peggad order en limiterad order att köpa eller sälja en angiven mängd av ett värdepapper till ett visat pris som fastställts för att följa en prisnivå i handelsplatsens orderbok.

⁴⁰ Denna latens är en teknisk nödvändighet som är specifik för varje handelsplats som föreslår den peggade ordertypen (denna information offentliggörs normalt sett inte).

⁴¹ För varje tabell som presenteras nedan visar de två vänstra kolumnerna ("BID") order för att köpa aktier som redan är för handa i orderböckerna, medan de två högra kolumnerna ("ASK") visar order för att sälja aktier som redan är för handa i orderböckerna.

Händelse 1: Ordern inges i handelsplats M:s orderbok.

Status i handelsplats M:s orderbok när ordern inges

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
250	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

Mot bakgrund av handelsplats M:s orderbok ansluter sig den ingivna peggade ordern automatiskt till andra order till det bästa anbudspriset (ursprungligt gränspris på 99,99 euro).

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:32.652785Z	Den peggade ordern rankas med lägst prioritet. Prioritetstidsstämpeln ska dock anges för att avgöra prioriteten mellan olika peggade order.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	P	Enligt handelsplats M:s egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	En peggad order är en limiterad order med ett gränspris som ändras automatiskt.

Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	99,99	
27	Peggat gränspris	100,10	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	150	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	150	
38	Visad kvantitet	150	Ingen gömd kvantitet.

Händelse 2: Gränspriset för den peggade ordern ändras när en ny order inges i orderboken.

Klockan 10:10:45.685975(UTC) inges en giltig-under-dagen-order om köp av 200 aktier för 100,00 euro i orderboken. Denna order handlas inte och visas fortsatt i orderboken. Därför, 50 millisekunder senare, ändras gränspriset för den peggade ordern till att överensstämma med gränspriset för den sista ingivna köpordern.

Status i handelsplats M:s orderbok

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
350	100,00	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80	100,20	100
100	99,75		

Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten			
N	Fält		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:45.735975 Z	Ordern ändras för att överensstämma med den nya order som inges, efter en fördröjning av 50 millisekunder.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			

13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:32.735975Z	Oförändrad.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	REMA	Ersatt av marknadsoperationer. Den peggade orderns gränsspris modifieras automatiskt av handelsplatsens system.
Avsnitt I – Priser			
24	Gränsspris	100,00	Gränsspriset ändras så att det överensstämmer med det bästa nya budet.
27	Peggat gränsspris	100,10	Oförändrat.

Händelse 3: En ny limiterad köporder inges i orderboken, handlas upp till 100,15 euro och fylls inte helt.

Klockan 10:10:59.256789(UTC) inges en giltig-under-dagen limiterad köporder avseende 600 aktier för 100,15 euro. För denna order handlas 100 aktier för 100,03 euro, 100,05 euro, 100,08 euro, 100,10 euro respektive 100,15 euro. Den återstående delen (100) kvarstår i orderboken. 50 millisekunder efter det sista utförandet modifieras gränsspriset för den peggade ordern genom marknadsoperationer från 100,00 euro till 100,10 euro. Den peggade orderns gränsspris kan inte sättas högre eftersom gränsspriset begränsades till 100,10 euro av handlaren.

Status i handelsplats M:s orderbok

BID		ASK	
Kvantitet	Gränsspris	Gränsspris	Kvantitet
100	100,15	100,20	100
150	100,10		
200	100,00		

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
		Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-03-07T10:10:59.306789Z	50 ms	efter det senaste genomförandet.

Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:10:32.652785Z	<i>Oförändrad.</i>
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	REMA	Ersatt av marknadsoperationer. Gränspriset för den peggade ordern modifieras automatiskt av handelsplats M:s system.
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	100,10	Gränspriset är begränsat till 100,10 (såsom specificeras i fält 27).
27	Peggat gränspris	100,10	<i>Oförändrat.</i>

6.13.5 Klassificering av en stopporder

Exempel 134

Den 7 mars 2018 klockan 10:05:32.652785(UTC) inger ett värdepappersföretag en stopporder för köp av 150 aktier för det finansiella instrumentet på handelsplats M. Ordern ska utlösas när aktien handlas för 100,02 euro eller högre. När ordern utlöses blir den

- enligt alternativ A: en marknadsprisorder (utan gränspris), eller
- enligt alternativ B: en limiterad order (med ett gränspris på 101,00 euro).

Orderns giltighetsperiod är giltig-tills-annullerad, vilket innebär att ordern förblir i orderboken antingen tills den utlöses eller annulleras.

Händelse 1: Ordern inges i handelsplats M:s orderbok.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:05:32.652785Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:05:32.652785Z	Eftersom ordern precis har förts in i orderboken är dess prioritetstidsstämpel samma som datumet och tiden för införandet. Prioritetstidsstämpeln för en

			stopporder ska bedömas gentemot andra stopporder.
Avsnitt F – Orderns identifieringskod			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	4 enligt <u>alternativ A</u> och S enligt <u>alternativ B</u>	Enligt handelsplatsens egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	STOP	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	[tom] enligt <u>alternativ A</u> och 101,00 enligt <u>alternativ B</u>	
26	Stoppris	100,02	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
33	Orderstatus	INAC	
36	Ursprunglig kvantitet	150	

Händelse 2: En marknadsaktör köper 20 aktier för 100,02 euro på handelsplats M och utlöser således stoppordern.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:05:55.652785Z	Den utlösande händelsen inträffar 23 sekunder efter att handelsplatsen tagit emot stoppordern.
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar			
10	Giltighetsperiod	IOCV	"Genomför genast eller annullera"
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			

21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	TRIG	Utlöst
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	4 enligt alternativ A S enligt alternativ B	När den aktiveras är ordertypen fortfarande densamma, men däremot ändras dess klassificering (fält 23).
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	När den väl har aktiverats ska stoppordern klassificeras som en limiterad order.
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	[tom] enligt <u>alternativ A</u> och 101,00 enligt <u>alternativ B</u>	
26	Stoppris	100,02	Stoppriset ska fortsatt fyllas i även om det inte ska beaktas när statusen väl övergår till "ACTI" i fält 33.
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ACTI	När stoppordern utlöses blir statusen "aktiv".

6.13.6 Dirigerade order

Exempel 135

Den 7 mars 2018 klockan 10:05:32(UTC) inger värdepappersföretag X en limiterad köporder för utförande till handelsplats M. Ordern avser förvärv av 150 aktier för 100,02 euro. När ordern inges till handelsplats M specificerar handlaren att ordern ska dirigeras till en annan handelsplats (handelsplats N) om den inte kan fyllas helt (alternativ A) eller delvis (alternativ B) på handelsplats M. Enligt båda alternativen dirigeras den volym som inte handlas (enligt alternativ A) eller den resterande volymen (enligt alternativ B) av ordern till handelsplats N.

Den dirigerade ordern utförs delvis på handelsplats N. Denna transaktion på handelsplats N ska registreras i handelsplats M:s system.

Enligt båda alternativen specificerar handlaren också att om ordern inte kan fyllas helt på handelsplats N ska den returneras till handelsplats M. Därför återaktiveras ordern i handelsplats M:s orderbok, efter att delvis ha utförts på handelsplats N.

Vad gäller dirigeringen av ordern från handelsplats M till handelsplats N tillhandahåller värdepappersföretag Z, som handlar i egenskap av medlem i handelsplats N, en DEA-tjänst.

Orderböckernas status⁴² innan ordern inges till handelsplats M

Orderbokens status vid handelsplats M där ordern ursprungligen inges

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100

Orderbokens status vid handelsplats N dit ordern dirigeras

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	99,99	100,01	100
100	99,98	100,03	100
100	99,95	100,04	100
100	99,90	100,05	100
100	99,80	100,08	100

Händelse 1: Ordern inges i handelsplats M:s orderbok.

Status i handelsplats M:s orderbok när ordern inges

BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
150	100,02	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80		

Mot bakgrund av orderboken på handelsplats M kan den ingivna limiterade ordern inte fyllas (den matchar inte alls den motsatta sidan).

Ordern ska återspeglas i handelsplats M:s register som en ny order (se vidare avsnitt 6.13.1). Dessutom ska dirigeringsstrategi (fält 47) fyllas i som en alfanumerisk text (upp till 50 tecken), med förbehåll för handelsplats M:s specifikation.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)

⁴² För varje tabell som presenteras nedan visar de två vänstra kolumnerna ("BID") order för att köpa aktier som redan är för handa i orderböckerna, medan de två högra kolumnerna ("ASK") visar order för att sälja aktier som redan är för handa i orderböckerna. I dessa riktlinjer speglar varje limiterad order endast en order.

Avsnitt J – Orderinstruktioner			
47	Dirigeringsstrategi	ROUTING_TO_TVN_ONLY	Alfanumerisk text (upp till 50 tecken), med förbehåll för specificering från handelsplats M.

Händelse 2: Ordern dirigeras till handelsplats N.

Enligt alternativ A

Eftersom ordern inte kan fyllas för 100,02 euro på handelsplats M när den förs in i orderboken dirigeras den till handelsplats N i enlighet med de instruktioner som handlaren har gett. Som ett resultat avlägsnas ordern från handelsplats M:s orderbok. Om ordern emellertid inte kan fyllas helt på handelsplats N kommer den kvantitet som inte har handlats tillbaka till handelsplats M:s orderbok i enlighet med handlarens ursprungliga instruktioner.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:05:32.652788Z	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	CHMO	"Statusförändring genom marknadsoperationer"
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ROUT	Ordern dirigeras till handelsplats N.
36	Ursprunglig kvantitet	150	Ingen ändring.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	150	Detta fält avser även den kvantitet som omdirigeras till den andra handelsplatsen.
38	Visad kvantitet	0	När den dirigeras till en annan handelsplats visas inte någon kvantitet för ordern på handelsplats M.

Enligt alternativ B

Orden genomfördes delvis på handelsplats M (förvärv av 25 aktier) innan den dirigerades till handelsplats N med den kvarvarande kvantiteten (125 aktier). Denna orderdirigering som följer av en delvis händelse återspeglas i handelsplats M:s register i följande fält:

N	Fält	Standarder och format	Beskrivning
---	------	-----------------------	-------------

för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten			(i förekommande fall)
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ROUT	Ordern DIRIGERAS till handelsplats N.
36	Ursprunglig kvantitet	150	<i>Ingen ändring.</i>
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	125	Detta speglar en kvantitet som fortfarande ska handlas efter förvärv av 25 aktier på handelsplats M.
38	Visad kvantitet	0	När den dirigeras till en annan handelsplats visas inte någon kvantitet för ordern på handelsplats M.
39	Handlad kvantitet		Förvärvet av 25 aktier registrerades i en tidigare händelse.

Följande tabell visar hur den inkommande ordern som dirigeras från handelsplats M återspeglas i registret för handelsplats N.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna			
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	LEI för värdepappersföretag Z som är medlem i handelsplats N och vidarebefordrar orden för handelsplats M:s räkning	
2	Direkt elektronisk åtkomst (DEA)	true	
3	Identifieringskod för kund	LEI för handelsplats M	I denna situation är handelsplats M kund till medlemmen i handelsplats N (värdepappersföretag Z). Om det finns en mellanhand mellan dem ska inte handelsplats M:s LEI anges i detta fält.
Avsnitt B – Handelskapacitet och likviditet			
7	Handelskapacitet	AOTC	Värdepappersföretag Z handlar för handelsplats M:s räkning.

Avsnitt F – Orderns identifieringskod			
16	MIC-kod för segment	MIC-kod för segment från handelsplats N	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	IOC_ORDER	Enligt handelsplats N:s egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	150 enligt alternativ A och 125 enligt alternativ B	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	150 enligt alternativ A och 125 enligt alternativ B	

Händelse 3: Ordern fylls delvis när den förs in i handelsplats N:s orderbok.

Ordern ska återspeglas i handelsplats N:s register som en delvis fylld order (se avsnitt 6.13.1.4). Dessutom ska fält 48 fyllas i på följande sätt:

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	DEF54321	

Enligt alternativ A

När ordern förs in i handelsplats N:s orderbok köps 100 aktier på handelsplats N. Detta köp på handelsplats N ska återspeglas i registret för handelsplats M som hänför sig till den ursprungliga ordern.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran	Beskrivning (i förekommande fall)
---	------	---	-----------------------------------

tillhandahålls den behöriga myndigheten			
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:05:32.662788Z	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	PARF	Ordern är delvis fylld.
Avsnitt I – Priser			
28	Transaktionspris	100,01	Ordern har delvis genomförts på handelsplats N för 100,01.
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
33	Orderstatus	ROUT	<i>Ingen ändring.</i>
36	Ursprunglig kvantitet	150	<i>Ingen ändring.</i>
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	50	
38	Visad kvantitet	0	Eftersom ordern fortfarande är under "dirigerad status".
39	Handlad kvantitet	100	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner		Detta fält ska lämnas tomt eftersom transaktionen inte utfördes på handelsplats M.

Enligt alternativ B

Innan ordern dirigeras till handelsplats N genomförs den delvis på handelsplats M (förvärv av 25 aktier). Således hänför sig den order som dirigeras till handelsplats N endast till 125 aktier. Ordern utförs delvis vid införandet i handelsplats N:s orderbok (förvärv av 100 aktier).

Handeln på handelsplats N ska återspeglas i handelsplats M:s register såsom föreskrivs i följande tabell, med undantag för följande fält:

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande		PARF	Ordern är delvis fylld.
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
33	Orderstatus		ROUT	

36	Ursprunglig kvantitet	150	Den ursprungliga kvantiteten är oförändrad enligt alternativ B.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	25	25 aktier har redan förvärvats på handelsplats M innan ordern dirigerades.
38	Visad kvantitet	0	
39	Handlad kvantitet	100	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner		Detta fält ska lämnas tomt eftersom transaktionen inte utfördes på handelsplats M.

Händelse 4: Den dirigerade ordern återaktiveras i handelsplats M:s orderbok.

N		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-03-07T10:05:32.662791Z		
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:05:32.662791Z	Ordern förlorade sin prioritetstidsstämpel när den dirigerades till handelsplats N. Prioritetstidsstämpeln motsvarar den tidpunkt vid vilken den återkommer till handelsplats M:s orderbok.	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	CHMO	”Statusförändring genom marknadsoperationer”	
Avsnitt I – Priser				
24	Gränspris	100,02	Ingen ändring.	
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
33	Orderstatus	ACTI	Vid denna händelse blir ordern aktiv i orderboken för handelsplats M.	
36	Ursprunglig kvantitet	150	Ingen ändring.	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	50 enligt alternativ A och 25 enligt alternativ B		
38	Visad kvantitet	50 enligt alternativ A		

		och 25 enligt alternativ B	
--	--	-------------------------------	--

6.13.7 Klassificering av strategirelaterad order (fält 46)

6.13.7.1 Implicit (implied-in) funktion

Exempel 136

Värdepappersföretag X:s order

Värdepappersföretag X vill inge en order för julioptionen (lösen 225) till handelsplats M. Den 18 mars 2018 klockan 10:07:16.523871(UTC) lämnar värdepappersföretag X in en direkt order för köp av 200 köpoptioner som löper ut i juli med en lösen på 225 och ett pris på 13 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för köpoptionerna för juli är 256718 och ISIN är XX1234567890.

Värdepappersföretag Y:s order

Ett annat värdepappersföretag (företag Y) vill inge en order för augustioptionen (lösen 225) till handelsplats M. Den 7 mars 2018, klockan 10:09:38.981242(UTC), lämnar värdepappersföretag Y in en direkt order för försäljning av 100 köpoptioner som löper ut i augusti med en lösen på 225 och ett pris på 15,5 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för augustiköpoptionerna är 256735 och ISIN är XXABCDEFGHJIJ.

Implicit (implied-in) order – tidsspread för optioner

Den implicita orderfunktionen hos handelsplats M innebär att dessa två direkta order genererar en implicit order i optionsstrategin för tidsspread. Denna implicita order är att sälja 100 juli-augusti FCAL till ett pris av 2,5 euro. Detta sprids till marknaden via uppgifterna. Handelsplats M:s orderbokskod för FCAL juli-augusti 225 är 256786.

Värdepappersföretag Z:s order

Värdepappersföretag Z, vars LEI är KLMNOPQRST1234567890, vill lämna in en order i samma tidsspread för optioner. Den 7 mars 2018 klockan 10:09:56.684251(UTC) inger värdepappersföretag Z en tidsspreadorder för att köpa 100 juli-augusti FCAL 225 till ett pris av 2,5 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för FCAL juli-augusti 225 är 256786. Denna utförs genast mot ovannämnda implicita order.

Händelse 1: Ordern från värdepappersföretag X förs in i orderboken.

Orderbokens status⁴³ när den nya ordern förs in (den nya ordern markeras i rött):

⁴³ För varje tabell som presenteras nedan visar de två vänstra kolumnerna ("BID") de köporder som redan är för handa i orderböckerna, medan de två högra kolumnerna ("ASK") visar de säljorder som redan är för handa i orderböckerna. Vid tillämpningen av dessa riktlinjer finns det endast en order på varje prisnivå.

Köption 225 för juli			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Köption 225 för augusti			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

FCAL juli-augusti 225			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	2,00	5,25	100

För köptionen 225 för juli: Den direkta ordern från värdepappersföretag X avser köp av 200 köptioner för juli med ett lösenpris på 225 till ett pris av 13 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för köptionerna 225 för juli är 256718. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna				
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	12345678901234567890		
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-03-07T10:07:16.523871Z		
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Eftersom ordern precis har förts in i orderboken är dess prioritetstidsstämpel samma som datumet och tiden för införandet.	
15	Ordningsnummer	3758945		
Avsnitt F – Identifiering av ordern				

17	Orderbokskod	256718	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890	
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F458s	Handelsplatsens unika orderkod.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	Även om ordern utförs när den förs in i orderboken ska den första händelsen rapporteras som "ny order".
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Gräns	Enligt handelsplatsens egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	13	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	200	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	200	
38	Visad kvantitet	200	
46	Identifiering av strategirelaterad order		Tom, eftersom den ännu inte har utförts.

Händelse 2: Ordern från värdepappersföretag Y förs in i orderboken.

Orderbokens status⁴⁴ när den nya ordern förs in (den nya ordern markeras i rött):

Köption 225 för juli				Köption 225 för augusti			
BID		ASK		BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet	Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
200	13,00	13,25	100	100	15,25	15,50	100
100	11,25	13,30	100	100	15,20	16,50	100
100	11,20	13,35	100	100	15,15	16,55	100
100	11,15					16,65	100

⁴⁴ För varje tabell som presenteras nedan visar de två vänstra kolumnerna ("BID") de köporder som redan är för handa i orderböckerna, medan de två högra kolumnerna ("ASK") visar de säljorder som redan är för handa i orderböckerna. Vid tillämpningen av dessa riktlinjer finns det endast en order på varje prisnivå.

FCAL juli-augusti 225			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	2,00	5,25	100

För augustiköptionen 225: Den direkta ordern från värdepappersföretag Y avser försäljning av 100 köpoptioner för augusti med ett lösenpris på 225 till ett pris av 15,5 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för köpoptionerna 225 för augusti är 256718. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna			
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	ABCDEFGHJKLMNOPQRST	
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Eftersom ordern precis har förts in i orderboken är dess prioritetstidsstämpel samma som datumet och tiden för införandet.
15	Ordningsnummer	3758946	
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
17	Orderbokskod	256735	Handelsplatsens orderbokskod.
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XXABCDEFGHJIJ	
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F459n	Handelsplats M:s unika orderkod.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	Även om ordern utförs när den förs in i orderboken ska den första händelsen rapporteras som "ny order".
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Gräns	Enligt handelsplats M:s egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	

Köption 225 för juli			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Köption 225 för augusti			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	15,5	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	SELL	
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	100	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100	
38	Visad kvantitet	100	
46	Identifiering av strategirelaterad order		Tom, eftersom den ännu inte har utförts.

Händelse 3: Den implicita ordern förs in i orderboken.

Orderbokens status⁴⁵ när den implicita ordern förs in (den nya ordern markeras i rött):

FCAL juli-augusti 225			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	2,00	2,50	100
		5,25	100

För orderboken för FCAL juli-augusti 225: En implicit order genereras av handelsplats M från dessa två direkta order som värdepappersföretagen X och Y har ingett med avseende på köptionerna för juli och augusti. Den implicita ordern är en order avseende försäljning av 100 juli-augusti FCAL till ett pris av 2,5 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för orderboken för FCAL juli-augusti 225 är 256786. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla. Fälten 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 och 8 ska alltid vara tomma eftersom detta är en implicit order som har genererats av handelsplatsen och inte av medlemmen/deltagaren.

⁴⁵ Vid tillämpningen av dessa riktlinjer finns det endast en order på varje prisnivå.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Eftersom ordern precis har förts in i orderboken är dess prioritetstidsstämpel samma som datumet och tiden för införandet.
15	Ordningsnummer	3758947	
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
17	Orderbokskod	256786	Handelsplats M:s orderbokskod.
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Eftersom strategier inte är finansiella instrument saknar de ISIN. Därför ingår de ISIN som strategin utgörs av.
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F460g	Handelsplats M:s unika orderkod.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	Även om ordern utförs när den förs in i orderboken ska den första händelsen rapporteras som "ny order".
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Implicit	Enligt handelsplatsens egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	2,5	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	SELL	
33	Orderstatus	IMPL	För att markera att detta är en implicit order från de direkta.
36	Ursprunglig kvantitet	100	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100	
38	Visad kvantitet	100	
46	Identifiering av strategirelaterad order		Tom, eftersom den ännu inte har utförts.

Händelse 4: Värdepappersföretag Z:s order förs in i orderboken.

Status i orderboken (ny order markerad i rött):

Köption 225 för juli			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Köption 225 för augusti			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

FCAL juli-augusti 225			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

För FCAL juli-augusti 225: Tidsspreadordern från värdepappersföretag Z avser köp av 100 juli-augusti FCAL till ett pris av 2,5 euro. Handelsplats M:s orderbokskod för orderboken för FCAL juli-

augusti 225 är 256786. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N		Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna					
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	KLMNOPQRST1234567890			
Avsnitt C – Datum och tid					
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:56.684251Z			
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer					
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:09:56.684251Z		Eftersom ordern precis har förts in i orderboken är dess prioritetstidsstämpel samma som datumet och tiden för införandet.	
15	Ordningsnummer	3759523			
Avsnitt F – Identifiering av ordern					
17	Orderbokskod	256786		Handelsplats M:s orderbokskod.	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ		Eftersom strategier inte är finansiella instrument saknar de ISIN. Därför ingår de ISIN som strategin utgörs av.	
20	Identifieringskod för ordern	Xj26H127c		Handelsplats M:s unika orderkod.	

Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	Även om ordern utförs när den förs in i orderboken ska den första händelsen rapporteras som "ny order".
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Gräns	Enligt handelsplatsens egen klassificering.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	2,5	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
33	Orderstatus	ACTI	
36	Ursprunglig kvantitet	100	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100	
38	Visad kvantitet	100	
46	Identifiering av strategirelaterad order		Tom, eftersom den ännu inte har utförts.

Händelse 5: Utförande i orderboken för tidsspread och ändringar av order i de direkta avtalen.

Orderbokens status⁴⁶ vid utförandet:

⁴⁶ De order som är markerade i orange utförs och detta medför en uppdatering av den order som är markerad i blått och ett fullständigt genomförande av den order som är markerad i violett.

Köption 225 för juli			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	13,00	13,00	100
100	11,25	13,25	100
100	11,20	13,30	100
100	11,15	13,35	100

Köption 225 för augusti			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	15,50	15,50	100
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

FCAL juli-augusti 225			
BID		ASK	
Kvantitet	Gränspris	Gränspris	Kvantitet
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Tidsspreadordern från värdepappersföretag Z avseende köp av 100 juli-augusti FCAL till ett pris av 2,5 euro utförs i sin helhet. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna			
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade orden	KLMNOPQRST1234567890	Ingen ändring.
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Tid för denna händelse.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet		Tom, eftersom ordern handlas i sin helhet och således inte längre är aktiv.
15	Ordningsnummer	3759539	Ordningsnumret för detta meddelande.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
17	Orderbokskod	256786	Ingen ändring.
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Ingen ändring.

20	Identifieringskod för ordern	Xj26H127c	Ingen ändring.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	FILL	Ordern handlas i sin helhet.
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Gräns	Ingen ändring.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	Ingen ändring.
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	2,5	Ingen ändring.
28	Transaktionspris	2,5	Utförandepris.
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	Ingen ändring.
33	Orderstatus		Tom, eftersom ordern har handlats i sin helhet.
36	Ursprunglig kvantitet	100	Ingen ändring.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	0	Den kvarvarande kvantiteten är nu 0.
38	Visad kvantitet	0	Den visade kvantiteten är 0, eftersom den har handlats i sin helhet.
39	Handlad kvantitet	100	För att återspegla den handlade kvantiteten.
46	Identifiering av strategirelaterad order		Tom, eftersom denna order fördes in direkt i orderboken för tidsspread.
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	TEKXC456GH20	Ifylld, för att tillhandahålla ett unikt handels-id för den utförda handeln.

För säljordern i orderboken för tidsspread: Den implicita ordern avseende försäljning av 100 juli-augusti FCAL till ett pris av 2,5 euro utförs i sin helhet. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla. Fälten 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 och 8 ska alltid vara tomma eftersom detta är en implicit order som har genererats av handelsplatsen och inte av medlemmen/deltagaren.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Tid för denna händelse.	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				

13	Tidsstämpel för prioritet		Tom, eftersom ordern handlas i sin helhet och således inte längre är aktiv.
15	Ordningsnummer	3759540	Ordningsnumret för detta meddelande.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
17	Orderbokskod	256786	Ingen ändring.
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Ingen ändring.
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F460g	Ingen ändring.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	FILL	Ordern handlas i sin helhet.
Avsnitt H – Ordertyp			
22	Ordertyp	Implicit	Ingen ändring.
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	Ingen ändring.
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	2,5	Ingen ändring.
28	Transaktionspris	2,5	Utförandepris.
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	SELL	Ingen ändring.
33	Orderstatus		Tom, eftersom ordern har handlats i sin helhet.
36	Ursprunglig kvantitet	100	Ingen ändring.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	0	Den kvarvarande kvantiteten är nu 0.
38	Visad kvantitet	0	Den visade kvantiteten är 0, eftersom den har handlats i sin helhet.
39	Handlad kvantitet	100	För att återspegla den handlade kvantiteten.
46	Identifiering av strategirelaterad order	Xj26K983c	Ifylld för sammankoppling med de relevanta direkta order som var del av genomförandet.
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	TEKXC456GH20	Ifylld, för att tillhandahålla ett unikt handels-id för den utförda handeln.

För köptionen 225 för juli: Den direkta ordern från värdepappersföretag X avseende köp av 200 köpoptioner för juli med ett lösenpris på 225 till ett pris av 13 euro har fyllts delvis för 100. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N		Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna					
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	12345678901234567890		Ingen ändring.	
Avsnitt C – Datum och tid					
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:56.684251Z			
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer					
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-03-07T10:07:16.523871Z		Tid för införande av den direkta ordern.	
15	Ordningsnummer	3759541			
Avsnitt F – Identifiering av ordern					
17	Orderbokskod	256718		Ingen ändring.	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX1234567890		Ingen ändring.	
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F458s		Ingen ändring.	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern					
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	PARF			
Avsnitt H – Ordertyp					
22	Ordertyp	Gräns		Ingen ändring.	
23	Klassificering av ordertyp	LMTO		Ingen ändring.	
Avsnitt I – Priser					
24	Gränspris	13		Ingen ändring.	
28	Transaktionspris	13		Utförandepris.	
Avsnitt J – Orderinstruktioner					
32	Köp/sälj-indikator	BUYI		Ingen ändring.	
33	Orderstatus	ACTI		Ingen ändring.	
36	Ursprunglig kvantitet	200		Ingen ändring.	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100		.	
38	Visad kvantitet	100			
39	Handlad kvantitet	100		För att återspegla den handlade kvantiteten vid denna händelse.	
46	Identifiering av strategirelaterad order	Xj26K983c		Ifylld för sammankoppling med de relevanta direkta order till den implicita ordern som var del av genomförandet.	

48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	TEKXC456GH18	Ifylld, för att tillhandahålla ett unikt handels-id för den utförda handeln. Detta är ett annat handels-id än det i orderboken för tidsspread.
----	---	--------------	--

För augustiköptionen 225: Den direkta ordern från värdepappersföretag Y avseende försäljning av 100 köpoptioner för augusti med ett lösenpris på 225 till ett pris av 15,5 har utförts i sin helhet. I tabellen nedan är de huvudsakliga fält som ska fyllas i markerade, men inte alla:

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna				
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST	Ingen ändring.	
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-03-07T10:09:56.684251Z		
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13	Tidsstämpel för prioritet		Tom, eftersom ordern handlas i sin helhet och således inte längre är aktiv.	
15	Ordningsnummer	3759542		
Avsnitt F – Identifiering av ordern				
17	Orderbokskod	256735	Ingen ändring.	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XXABCDEFGHIJ	Ingen ändring.	
20	Identifieringskod för ordern	Xj26F459n	Ingen ändring.	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	FILL	Ordern handlas i sin helhet.	
Avsnitt H – Ordertyp				
22	Ordertyp	Gräns	Ingen ändring.	
23	Klassificering av ordertyp	LMTO	Ingen ändring.	
Avsnitt I – Priser				
24	Gränspris	15,5	Ingen ändring.	
28	Transaktionspris	15,5	Utförandepris.	
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
32	Köp/sälj-indikator	SELL	Ingen ändring.	

33	Orderstatus		Tom, eftersom ordern har handlats i sin helhet.
36	Ursprunglig kvantitet	100	Ingen ändring.
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	0	Den kvarvarande kvantiteten är nu 0.
38	Visad kvantitet	0	Den visade kvantiteten är 0, eftersom den har handlats i sin helhet.
39	Handlad kvantitet	100	För att återspegla den handlade kvantiteten.
46	Identifiering av strategirelaterad order	Xj26K983c	Ifylld för sammankoppling med de relevanta direkta order till den implicita ordern som var del av genomförandet.
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	TEKXC456GH19	Ifylld, för att tillhandahålla ett unikt handels-id för den utförda handeln. Detta är ett annat handels-id än det i orderboken för tidsspread.

6.13.7.2 Implied-out funktion

Samma metod ska användas för implied-out order.

6.13.8 Ändrad prioritet

Följande situationer beskrivs:

- Prioritetstidsstämplar för handelssystem som avser prioritet mellan pris-synlighet-tid.
- Prioritetstidsstämplar och prioriterad orderstorlek för ett handelssystem med prioritet för storlek-tid.
- Prioritetstidsstämplar och prioriterad orderstorlek för ett proportionellt handelssystem för matchning.

6.13.8.1 Prioritet mellan pris-synlighet-tid

Exempel 137

Värdepappersföretag X inger en ny giltig-tills-annullerad köporder för 50 aktier med gränspriset 10 000 euro den 30 juni 2018 klockan 11:20:30.112121(UTC) (händelse 1). Ett ögonblick senare, klockan 11:20:31.354454(UTC), inger värdepappersföretag Y en ny giltig-under-dagen köporder för 70 aktier med samma gränsprisnivå på 10 000 euro (händelse 2).

På grund av regeln om tidsprioritet kommer ordern på 70 aktier att placeras i handelsplatsens orderbok med samma prisnivå, men bakom ordern på 50 aktier. De olika prioriteringarna fastställs genom värdena i fältet avseende tidsstämpel för prioritet.

Om ordern på 50 aktier modifieras genom att kvantiteten ökas till 55 aktier den 27 juni 2018 klockan 11:20:33.344541(UTC) kommer den att förlora sin prioritet över ordern på 70 aktier. Därför ska den exakta tiden för en sådan ordermodifiering registreras i fältet avseende tidsstämpel för prioritet (händelse 3).

På denna handelsplats är giltig-tills-annullerad-order giltiga i ett år.

Händelse 1: Ingivande av en ny giltig-tills-annullerad köporder för 50 aktier.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-06-27T11:20:30.112121Z
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
10	Giltighetsperiod	GTCA
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	2018-06-27T23:59:59.999999Z
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:30.112121Z
Avsnitt F – Identifiering av ordern		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränspris	10000
28	Transaktionspris	
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
36	Ursprunglig kvantitet	50

Händelse 2: Ingivande av en ny giltig-under-dagen köporder för 70 aktier.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-06-27T11:20:31.354454Z
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
10	Giltighetsperiod	DAVY
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	2018-06-27T23:59:59.999999Z

Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:31.354454Z
Avsnitt F – Identifiering av ordern		
20	Identifieringskod för ordern	45533344ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	NEWO
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränspris	10000
36	Ursprunglig kvantitet	70

Händelse 3: Order på 50 aktier modifieras.

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-06-27T11:20:33.344541Z
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
10	Giltighetsperiod	GTCV
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	2018-06-27T23:59:59.999999Z
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:33.344541Z
Avsnitt F – Orderns identifieringskod		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	REME
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränspris	10000
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
36	Ursprunglig kvantitet	55

6.13.8.2 Prioritet mellan storlek-tid

Exempel 138

Värdepappersföretag X ingiver en ny köporder för 100 aktier på en viss prisnivå den 27 juni 2018 klockan 11:20:30.112121(UTC) (händelse 1).

En ögonblick senare, klockan 11:20:31.354454(UTC), ingiver värdepappersföretag Y en ny köporder på samma prisnivå men med större kvantitet (325 aktier) (händelse 2). På denna handelsplats prioriteras order för större kvantiteter framför order för lägre kvantiteter.

På grund av prioriteten mellan storlek och tid kommer ordern på 325 aktier att placeras före ordern på 100 aktier i boken. Den behöriga myndigheten kan rekonstruera detta genom att först beakta prioriterad storlek och sedan tidsstämpelein för prioritet för de order som – för varje order separat – är registrerade av handelsplatsen i de respektive fälten avseende tidsstämpel för prioritet och prioriterad storlek. Om ordern på 325 aktier modifieras genom att kvantiteten minskas till 90 aktier den 27 juni 2018 klockan 11:20:35.325891(UTC) kommer den att förlora sin prioritet över ordern på 100 aktier. Denna ordermodifiering ska registreras i fälten avseende tidsstämpel för prioritet och prioriterad storlek (händelse 3).

För de händelser som beskrivs ovan ska fälten för tidsstämpel för prioritet och prioriterad storlek fyllas i – separat för varje order och ordermodifiering – såsom följer. Av praktiska skäl inkluderas enbart fälten 13 och 14 eftersom dessa är mest relevanta i detta exempel.

Händelse 1: Ingivande av ordern på 100 aktier.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Prioriterad storlek	100

Händelse 2: Ingivande av ordern på 325 aktier.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:31.354454Z
14	Prioriterad storlek	325

Händelse 3: Modifiering av ordern på 325 aktier till en kvantitet på 90 aktier.

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer		

13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T11:20:35.325891Z
14	Prioriterad storlek	90

6.13.8.3 Proportionellt handelssystem för matchning

Exempel 139

Värdepappersföretag X ingår en ny köporder för 200 aktier med gränspriset 10 000 euro den 27 juni 2018 klockan 11:20:30.112121(UTC) i en orderbok som använder sig av en proportionell matchningsalgoritm där kvantiteten hos en inkommande order distribueras på alla väntande order i proportion till deras tillgängliga kvantitet.

Handelsplatser som använder proportionella matchningsalgoritmer kan fylla i värdet "0" (noll) i fält 14 avseende prioriterad storlek, under förutsättning att de har publicerat algoritmdetaljer som gör det möjligt för de behöriga myndigheterna att återskapa mekanismerna för orderutförandet. Således ska fälten 13 och 14 fyllas i på följande sätt:

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet		2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Prioriterad storlek		0

6.13.9 Handelsfaser

Exempel 140

Handelsplats M har en inledande auktion i ett finansiellt instrument som börjar klockan 07:50:00.425381(UTC+1) den 27 juni 2018. Före denna tidpunkt finns det inte några order i orderboken. Det vägledande auktionspriset har inte fastställts än, eftersom det inte finns några order och den vägledande auktionsvolymen är 0 aktier (händelse 1). Klockan 07:55:21.528754(UTC+1) ingår värdepappersföretag X en köporder för 100 aktier för 1 euro (händelse 2).

Klockan 07:57:46.255897(UTC+1) ingår värdepappersföretag Y en säljorder för 50 aktier på marknaden. Detta medför en matchning i orderboken och således ett vägledande pris på 1 euro och en vägledande volym på 50 aktier (händelse 3). Klockan 07:59:52.264547(UTC+1) ingår ett företag ett anbud för 25 aktier på marknaden. Detta påverkar inte det vägledande priset, men den vägledande volymen ökar till 75 aktier (händelse 4). Klockan 08:00:25.149531(UTC+1) matchas dessa order vid auktionens slut genom att de två säljorder som ingetts som händelserna 3 och 4 handlas med köpordern som ingetts i händelse 2, och sedan övergår värdepappret till kontinuerlig handel (händelse 5). Handelsfaserna visas i sin egen separata rad. En rad med handelsfasen ska bibehållas varje gång den ändras. Vägledande auktionspris och vägledande auktionsvolym visas tillsammans i sina egna rader när och om vart och ett av värdena ändras.

Händelse 1: Inledande auktion.

Rad 1 ska innehålla följande information med alla andra fält tomma (inbegripet fälten 50 [vägledande auktionspris] och 51 [vägledande auktionsvolym] eftersom dessa fält inte krävs för att visa en ändring av handelsfasen). De enda fält som ska fyllas i är följande:

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
15	Ordningsnummer	20056	
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
16	MIC-kod för segment	XMIC	
17	Orderbokskod	XYZ9876	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000	
20	Identifieringskod för ordern		Tom, eftersom handelsfasen har ändrats.
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande		
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
49	Handelsfaser	Inledande auktion	

Eftersom den inledande auktionen har börjat ska fältet för vägledande auktionspris vara tomt för att visa att det vägledande auktionspriset inte har fastställts och att den vägledande auktionsvolymen på 0 aktier ska bibehållas. Därför ska rad 2 visa denna information och alla andra fält ska vara tomma. De enda fält som ska fyllas i är följande:

N Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
15	Ordningsnummer	20068	
Avsnitt F – Identifiering av ordern			

16	MIC-kod för segment	XMIC	
17	Orderbokskod	XYZ9876	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000	
20	Identifieringskod för ordern		Tom, på grund av ändring av det vägledande priset och volymen.
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom inget pris har fastställts.
51	Vägledande auktionsvolym	0	Det finns ingen auktionsvolym.

Händelse 2: Ingivande av en order på 100 aktier.

Rad 3 av uppgifterna kommer att innehålla den nya order som förs in såsom anges nedan (inte alla fält avseende införande av order har inkluderats):

N		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-06-27T06:55:21.528754Z		
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T06:55:21.528754Z		
15	Ordningsnummer	20075		
Avsnitt F – Orders identifieringskod				
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC		
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	NEWO		
Avsnitt I – Priser				
24	Gränspris	1		
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
32	Köp/sälj-indikator	BUYI		
36	Ursprunglig kvantitet	100		
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	100		
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym				

49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

Händelse 3: Ingivande av en ny order på 50 aktier.

Rad 4 av uppgifterna kommer att innehålla den nya order som förs in såsom anges nedan (inte alla fält avseende införande av order har inkluderats):

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9		Datum och tid	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13		Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
15		Ordningsnummer	20089	
Avsnitt F – Identifiering av ordern				
20		Identifieringskod för ordern	987654321DEF	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21		Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt I – Priser				
24		Gränspris		Tom, i egenskap av marknadsorder utan angivet pris.
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
32		Köp/sälj-indikator	SELL	
36		Ursprunglig kvantitet	50	
37		Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	50	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym				
49		Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
50		Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
----	--------------------------	--	--

I rad 5 av uppgifterna visas vilka effekter införandet av ovanstående order får på det vägledande auktionspriset och den vägledande auktionsvolymen med alla andra fält tomma. De enda fält som ska fyllas i är följande:

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T06:57:46.255897Z	Ingen ändring.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
15	Ordningsnummer	20095	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
16	MIC-kod för segment	XMIC	
17	Orderbokskod	XYZ9876	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000	
20	Identifieringskod för ordern		Tom, på grund av ändring av det vägledande priset och volymen.
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
50	Vägledande auktionspris	1	
51	Vägledande auktionsvolym	50	

Händelse 4: Ingivande av en ny order på 25 aktier.

Rad 6 av uppgifterna kommer att innehålla den nya order som förs in såsom anges nedan (inte alla fält avseende införande av order har inkluderats):

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Den tid ordern ingavs.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Samma som tiden för ingivandet.
15	Ordningsnummer	20156	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			

20	Identifieringskod för ordern	543216789GHI	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	NEWO	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris		Tom, i egenskap av marknadsorder utan angivet pris.
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	SELL	
36	Ursprunglig kvantitet	25	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	25	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

I rad 7 av uppgifterna visas effekten på det vägledande auktionspriset och den vägledande auktionsvolymen med alla andra fält tomma. De enda fält som ska fyllas i är följande:

N		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Ingen ändring.	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
15	Ordningsnummer	20157	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.	
Avsnitt F – Identifiering av ordern				
16	MIC-kod för segment	XMIC		
17	Orderbokskod	XYZ9876		
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000		
20	Identifieringskod för ordern		Tom, på grund av ändring av det vägledande priset och volymen.	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym				

50	Vägledande auktionspris	1	Ingen ändring av auktionspriset på 1 £.
51	Vägledande auktionsvolym	75	Volymen är 75 aktier.

Händelse 5: Jämvikt vid auktionen och inledning på den kontinuerliga handeln.

Rad 8 av uppgifterna kommer att visa det delvisa fyllandet av köpordern för 100 aktier med 50 aktier (alla orderfält har inte inkluderats):

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Tiden för det delvisa fyllandet.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Samma som tiden för ingivandet eftersom ordern fortfarande är aktiv.
15	Ordningsnummer	20189	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	PARF	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris	1	
28	Transaktionspris	1	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	BUYI	
36	Ursprunglig kvantitet	100	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	50	
39	Handlad kvantitet	50	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	ABC123456	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

Rad 9 av uppgifterna kommer att visa fyllandet av säljordern för 50 aktier med 50 aktier (alla orderfält har inte inkluderats):

Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten			
N	Fält		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid			
9	Datum och tid	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Tiden för utförandet.
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer			
13	Tidsstämpel för prioritet		Tom, eftersom ordern inte längre är aktiv.
15	Ordningsnummer	20190	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.
Avsnitt F – Identifiering av ordern			
20	Identifieringskod för ordern	987654321DEF	
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern			
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	FILL	
Avsnitt I – Priser			
24	Gränspris		Tom, i egenskap av marknadsorder utan angivet pris.
28	Transaktionspris	1	
Avsnitt J – Orderinstruktioner			
32	Köp/sälj-indikator	SELL	
36	Ursprunglig kvantitet	50	
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	0	
39	Handlad kvantitet	50	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	ABC123456	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym			
49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.

51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.
----	--------------------------	--	--

Rad 10 av uppgifterna kommer att visa det delvisa fyllandet av köpordern för 50 aktier med 25 aktier (alla orderfält har inte inkluderats):

N		Fält		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid					
9	Datum och tid	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Tiden för det delvisa fyllandet.		
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer					
13	Tidsstämpel för prioritet	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Samma som tiden för ingivandet.		
15	Ordningsnummer	20256	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.		
Avsnitt F – Identifiering av ordern					
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC			
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern					
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	PARF			
Avsnitt I – Priser					
24	Gränspris	1			
28	Transaktionspris	1			
Avsnitt J – Orderinstruktioner					
32	Köp/sälj-indikator	BUYI			
36	Ursprunglig kvantitet	100			
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	25			
39	Handlad kvantitet	25			
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	DEF9876			
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym					
49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.		
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.		
51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.		

Rad 11 av uppgifterna kommer att visa fyllandet av säljorden för 25 aktier med 25 aktier (alla orderfält har inte inkluderats):

N		Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Tiden för utförandet.	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
13	Tidsstämpel för prioritet		Tom, eftersom ordern är fylld.	
15	Ordningsnummer	20257	Ordningsnumret för denna händelse är annorlunda.	
Avsnitt F – Identifiering av ordern				
20	Identifieringskod för ordern	543216789GHI		
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern				
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	FILL		
Avsnitt I – Priser				
24	Gränspris		Tom, i egenskap av marknadsorder utan angivet pris.	
28	Transaktionspris	1		
Avsnitt J – Orderinstruktioner				
32	Köp/sälj-indikator	SELL		
36	Ursprunglig kvantitet	25		
37	Kvarvarande kvantitet, inklusive dold	0		
39	Handlad kvantitet	25		
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	DEF9876		
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym				
49	Handelsfaser		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.	
50	Vägledande auktionspris		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.	
51	Vägledande auktionsvolym		Tom, eftersom den inte behövs för händelsen.	

Ändringen av handelsfas ska representeras av en egen rad i de uppgifter som ska bibehållas. Därför ska rad 12 innehålla följande information och alla andra fält ska vara tomma. De enda fält som ska fyllas i är följande:

N		Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten	Beskrivning (i förekommande fall)
Avsnitt C – Datum och tid				
9	Datum och tid	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Tidsstämpel med en granularitet på 1 mikrosekund.	
Avsnitt E – Prioritet och ordningsnummer				
15	Ordningsnummer	20258	Ordningsnumret för denna händelse på handelsplatsen.	
Avsnitt F – Identifiering av ordern				
16	MIC-kod för segment	XMIC	Ingen ändring.	
17	Orderbokskod	XYZ9876	Ingen ändring.	
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000	Ingen ändring.	
20	Identifieringskod för ordern		Tom, på grund av ändring av handelsfas.	
Avsnitt K – Handelsfaser, vägledande auktionspris och auktionsvolym				
49	Handelsfaser	Kontinuerlig handel	Den kontinuerliga handeln har inletts.	

6.14 RFQ-system (request for quote)

I ett RFQ-system lämnas ett eller flera bud till följd av en anbudsförfrågan som lämnats av en eller flera medlemmar eller deltagare. Budet är endast verkställbart av den medlem eller deltagare som lämnat anbudsförfrågan. Den medlem eller deltagare som lämnat anbudsförfrågan kan godkänna det eller de bud som inkommer. Budet kan godkännas automatiskt mellan vissa motparter.

Ett RFQ-system har särskilda egenskaper. För att bibehålla de relevanta uppgifter som hör samman med dessa särdrag ska tabellerna med fält fyllas i på ett visst sätt. Därför tillhandahålls exempel för följande RFQ-särdrag:

Exempel 141: Hur ska en anbudsförfrågan som skickats till särskilda motparter registreras?

Exempel 142: Hur ska ett bud till följd av en anbudsförfrågan med en begränsad giltighetstid ("måste antas direkt") registreras som endast är verkställbart för den särskilda aktör som lämnat anbudsförfrågan?

Exempel 143: Hur ska ett bud till följd av en anbudsförfrågan med en annan kvantitet än den efterfrågade registreras?

Exempel 144: Hur ska ett genomförande registreras i ett RFQ-system?

6.14.1 Registrering av en anbudsförfrågan som skickas till särskilda motparter

En anbudsförfrågan ska registreras som en ny order med angivande av identifieringskoden för ordern. Orderhändelsen (fält 21) ska fyllas i med "RFQS". På detta sätt kan den identifieras som en inlämnad RFQ.

Dessutom ska anbudsförfrågan registreras så att det framgår om den riktas till marknaden som helhet eller till särskilda motparter. I detta syfte ska dirigeringsstrategin (fält 47) användas. Om fältet avseende dirigeringsstrategi lämnas tomt visas att anbudsförfrågan skickats till alla medlemmar eller deltagare i handelsplatsen. Å andra sidan ska en LEI anges i fältet avseende dirigeringsstrategi för att visa att RFQ:n inlämnats till relevant företag. Om RFQ:n skickats till mer än ett företag ska ett nytt exemplar av tabellen med fält (med efterföljande LEI i fältet för dirigeringsstrategi) registreras, men i samtliga fall med samma identifieringskod för ordern.

Exempel 141

Värdepappersföretag X uttrycker den 27 juni 2018 klockan 13:05:10(UTC) intresse på en RFQ-handelsplats att sälja ett särskilt instrument med ISIN XX0000000000 genom en förfrågan om ett ensidigt bud som omfattar storlek (1 000), för försäljning av detta instrument till medlemmar som svarar på anbudsförfrågan. Anbudsförfrågan skickas enbart till två specificerade medlemmar: Värdepappersföretag Y (LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) och värdepappersföretag Z (LEI KLMNOPQRST1234567890). Hur ska RFQ-handelsplatsen visa detta i tabellen med fält?

Anbudsförfrågan från värdepappersföretag X till värdepappersföretag Y:

Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten		
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna		
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	12345678901234567890
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-06-27T13:05:10Z
Avsnitt F – Identifiering av ordern		
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
21	Ny order, ordermodifiering, annullering av order, orderavslag, helt eller delvist genomförande	RFQS ⁴⁷
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	SELL
36	Ursprunglig kvantitet	1000

⁴⁷ Denna kod nämns inte i kommissionens delegerade förordning 2017/580, men den omfattas av det fria formatfältet {ALPHANUM-4}. Handelsplatserna förväntas dock använda denna särskilda kod i detta särskilda fall.

47	Dirigeringsstrategi	ABCDEFGHJKLMNOPQRST
----	---------------------	---------------------

b) Anbudsförfrågan till värdepappersföretag Z (där tabellen med fält ska fyllas i på precis samma sätt som den ovan [inbegripet samma identifieringskod för ordern], med den enda skillnaden att värdepappersföretag Z:s LEI anges i fältet avseende dirigeringsstrategi).

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt F – Identifiering av ordern		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
47	Dirigeringsstrategi	KLMNOPQRST1234567890

För exempel på uppdatering av bud hänvisas läsaren till avsnitt 6.13.1.2.

6.14.2 Registrering av ett bud till följd av en anbudsförfrågan med begränsad giltighetstid ("måste antas direkt") som endast är verkställbart för den särskilda aktör som lämnat anbudsförfrågan

Exempel 142

Värdepappersföretag Y svarar på värdepappersföretag X:s anbudsförfrågan i exempel 141 ovan med ett ensidigt marknads(bud) på 8,750 euro för den begärda storleken (1 000) för instrument ISIN XX0000000000 den 27 juni 2018 klockan 13:06:07(UTC), vilket är giltigt i 10 minuter och verkställbart för värdepappersföretag X som lämnat anbudsförfrågan. Det framgår att det är frågan om ett bud till följd av anbudsförfrågan, eftersom orderhändelsen (fält 21) ska fyllas i med "RFQR". Sambandet mellan den som lämnat anbudsförfrågan och den som lämnar bud visas genom att den identifieringskod för ordern som är registrerad av RFQ-handelsplatsen anges i fältet avseende orderrestriktioner (fält 11) vid relevant anbudsförfrågan (se exempel 141).

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna		
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	ABCDEFGHJKLMNOPQRST
Avsnitt C – Datum och tid		
9	Datum och tid	2018-06-27T13:06:07Z
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
10	Giltighetsperiod	GTSV
11	Orderrestriktioner	123456789ABC
12	Giltighetsperiod och tidpunkt	2018-06-27T13:16:07Z

Avsnitt F – Identifiering av ordern		
18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000
20	Identifieringskod för ordern	23456789DEF
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	RFQR ⁴⁸
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränsspris	8,750
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	BUYI
36	Ursprunglig kvantitet	1000

6.14.3 Registrering av ett bud till följd av en anbudsförfrågan med en annan kvantitet än den efterfrågade

Exempel 143

Värdepappersföretag Z svarar på anbudsförfrågan i exempel 141 genom att lämna ett ensidigt (bud) på marknaden på 8,750 euro för en annan volym än den begärda storleken (värdepappersföretag X begärde 1 000, värdepappersföretag Z svarar med 600) för instrument ISIN XX0000000000, vilket är verkställbart för värdepappersföretag X som lämnat anbudsförfrågan. Sambandet mellan den som lämnat anbudsförfrågan och den som lämnar bud visas genom att den identifieringskod för ordern som är registrerad av RFQ-handelsplatsen anges i fältet avseende orderrestriktioner (fält 11) vid relevant anbudsförfrågan (se exempel 141).

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna		
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	KLMNOPQRST1234567890
Avsnitt D – Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
11	Orderrestriktioner	123456789ABC
Avsnitt F – Identifiering av ordern		

⁴⁸ Denna kod nämns inte i denna RTS, men den omfattas av det fria formatfältet {ALPHANUM-4}. Handelsplatserna förväntas dock använda denna särskilda kod i detta särskilda fall.

18	Identifieringskod för finansiella instrument	XX0000000000
20	Identifieringskod för ordern	78901223GHI
Avsnitt G – Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	RFQR ⁴⁹
Avsnitt H – Ordertyp		
22	Ordertyp	Gräns
23	Klassificering av ordertyp	LMTO
Avsnitt I – Priser		
24	Gränsspris	8,750
Avsnitt J – Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	BUYI
36	Ursprunglig kvantitet	600

6.14.4 Registrering av ett genomförande i ett RFQ-system

Exempel 144

Den som lämnat anbudsförfrågan, värdepappersföretag X, verkställer det bud som värdepappersföretag Y lämnar i exempel 142. Den transaktion som därigenom uppkommer visas genom två utförande händelser från den som lämnat anbudsförfrågan, värdepappersföretag X, och den som svarat på anbudsförfrågan, värdepappersföretag Y. Identifieringskoden för handelsplatstransaktioner (fält 48) ska fyllas i för var och en av händelserna för att visa de två bud som är inblandade i transaktionen. Därigenom kan en komplett verifieringskedja säkerställas för anbudsförfrågan, relevant svar på anbudsförfrågan och relevant transaktion. Den första tabellen visar den utförande händelsen med avseende på anbudsförfrågan för värdepappersföretag X:

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna		
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	12345678901234567890
Avsnitt D Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
11	Orderrestriktioner	
Avsnitt F – Orders identifieringskod		
20	Identifieringskod för ordern	123456789ABC
Avsnitt G Händelser som påverkar ordern		

⁴⁹ Denna kod nämns inte i denna RTS, men den omfattas av det fria formatfältet {ALPHANUM-4}. Handelsplatserna förväntas dock använda denna särskilda kod i detta särskilda fall.

21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	FILL
Avsnitt I – Priser		
28	Transaktionspris	8,750
Avsnitt J Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	SELL
39	Handlad kvantitet	1000
47	Dirigeringsstrategi	ABCDEFGHJKLMNOPQRST
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	GHIJ1234

Den andra tabellen visar den utförande händelsen med avseende på anbudsförfrågan för värdepappersföretag Y:

N	Fält	Standarder och format för de orderuppgifter som ska användas när relevanta orderdata på begäran tillhandahålls den behöriga myndigheten
Avsnitt A – Identifiering av de relevanta parterna		
1	Identifiering av enheten som vidarebefordrade ordern	ABCDEFGHJKLMNOPQRST
Avsnitt D Giltighetsperiod och orderbegränsningar		
11	Orderrestriktioner	123456789ABC
Avsnitt F – Orderns identifieringskod		
20	Identifieringskod för ordern	23456789DEF
Avsnitt G Händelser som påverkar ordern		
21	Ny order, modifiering, annullering, avslag, helt eller delvist genomförande	FILL
Avsnitt I – Priser		
28	Transaktionspris	8,750
Avsnitt J Orderinstruktioner		
32	Köp/sälj-indikator	BUYI
39	Handlad kvantitet	1000
47	Dirigeringsstrategi	
48	Identifieringskod för handelsplatstransaktioner	GHIJ1234

7 Riktlinjer om klocksynkronisering

Artikel 50 i MiFID II och de tillhörande tekniska standarderna för tillsyn är tillämpliga på handelsplatser och deras medlemmar och deltagare och föreskriver att dessa ska iaktta kraven på noggrannhet vad gäller den maximala avvikelsen för deras klockor från UTC och tidsstämplar för händelser som ska rapporteras med en viss granularitet.

7.1 Händelser som ska rapporteras

I artikel 50 i MiFID II hänvisas till skyldigheten för handelsplatserna och deras medlemmar/deltagare att synkronisera de klockor som används för att registrera datum och tid för varje "händelse som ska rapporteras". Esma anser att det är relevant att tillhandahålla exempel på "händelser som ska rapporteras" i den mening som avses i artikel 50.

Esma anser att en "händelse som ska rapporteras" innefattar någon av följande skyldigheter:

- Offentliggörande av tidpunkt för handel och tidpunkt för offentliggörande såsom föreskrivs i tabell 3 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/587 och bilaga II till tabell 1b i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/583 om transparens för aktier, aktieliknande och icke- aktieliknande instrument enligt artiklarna 6, 7, 10 och 11 i MiFIR.
- Transaktionsrapportering av tidpunkten för handel såsom föreskrivs i fält 28 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 enligt artikel 26 i MiFIR.
- Registrering av tidpunkten för händelser som påverkar de order och transaktioner som värdepappersföretag utför enligt artikel 25.1 i MiFIR, och kraven på rapportering (förutom inspelning av telefonsamtal eller annan elektronisk kommunikation) som härstammar från artikel 16.6 i MiFID II, såsom föreskrivs i artikel 74 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/565 av den 25 april 2016 (krav enligt artikel 16.6 i MiFID II).
- Registrering av tidpunkten för händelser som påverkar order som föreskrivs i fält 27 i tabell 2 och fälten 23, 24 and 33 i tabell 3 i bilaga II till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/589 enligt artikel 17.2 i MiFID II för värdepappersföretag som är verksamma med avseende på teknik för algoritmisk högfrekvenshandel.
- Registrering av tidpunkten för händelser som påverkar order såsom specificeras i fälten 9, 12 och 13 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 enligt artikel 25.2 i MiFIR.

7.2 Granularitet för tidsstämpel

Artikel 50 i MiFID II är tillämplig på ett brett spektrum av händelser som ska rapporteras (avsnitt 7.1). I kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 fastställs två typer av noggrannhetskrav, nämligen maximal avvikelse från UTC och granularitet för tidsstämplar. Detta avsnitt av riktlinjerna gäller enbart det senare kravet.

Det ska observeras att artikel 50 i MiFID II endast är tillämplig på händelser som ska rapporteras som äger rum på en handelsplats. Den är till exempel inte tillämplig på OTC-transaktioner.

En medlem eller deltagare i en handelsplats är inte skyldig att iaktta samma krav avseende tidsstämpel som är tillämpliga på den handelsplats där denne är medlem eller deltagare. Medlemmen eller deltagaren ska enbart tidsstämpla i enlighet med de krav som är tillämpliga på företagets handelsverksamhet enligt artikel 50 i MiFID II.

När en transaktion utförs genom en kedja av värdepappersföretag (den ursprungliga ordern vidarebefordras genom kedjan från ett värdepappersföretag till ett annat) ska varje värdepappersföretag i kedjan iaktta de krav på tidsstämpel som är tillämpliga på dess egen handelsverksamhet, oberoende av de krav på tidsstämpel som är tillämpliga på de andra värdepappersföretagen i kedjan.

Artikel 26 i MiFIR och artikel 16.6 i MiFID II – transaktionsrapportering och registrering av transaktioner och orderbehandling

7.2.1.1 Transaktioner som utförs på en handelsplats

När ett värdepappersföretag utför en transaktion på en handelsplats (t.ex. som medlem eller deltagare i en handelsplats) ska det rapportera fältet för datum och tidpunkt för handel med tillämpning av den granularitetsnivå som fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 för transaktioner som utförs på en handelsplats. Detta fastställs i avsnitt 5.4 "Utförande av en transaktion på en handelsplats" i del I i dessa riktlinjer. På liknande sätt ska värdepappersföretag som omfattas av kraven i artikel 16.6 i MiFID II registrera tiden för transaktioner som utförs på en handelsplats och order som inges till en handelsplats med tillämpning av samma granularitet som fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574.

7.2.1.2 Transaktioner som inte utförs på en handelsplats

Alla värdepappersföretag (oberoende av huruvida de är medlemmar eller deltagare i en handelsplats) ska tidsstämpla sina transaktionsrapporter med en granularitet i sekunder eller bättre i enlighet med fält 28 i tabell 2 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 för transaktioner som inte utförs på en handelsplats. På liknande sätt ska värdepappersföretag som omfattas av kraven i artikel 16.6 i MiFID II registrera tiden för transaktioner som inte utförs på en handelsplats och order som inte inges till en handelsplats till den närmaste sekunden.

För transaktioner som inte utförs på en handelsplats (dvs. OTC-transaktioner) föreskrivs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 att datum och tidpunkt i transaktionsrapporten ska vara "när parterna avtalar om innehållet i vissa fält".

7.2.1.3 Exempel

Nedan tillhandahålls exempel för att visa hur orderdata och transaktionsrapporter ska tidsstämpas. Det ska observeras att om tiden är i UTC+1 ska tidsstämpeln justeras till UTC-tid. I följande exempel antas värdepappersföretag X och värdepappersföretag Y vara skyldiga att rapportera transaktioner enligt artikel 26 i MiFIR.

Exempel 145: Order och transaktioner på en handelsplats

Värdepappersföretag X erhåller en order den 20 juni 2018 för ett kontant aktieinstrument från en kund genom ett elektroniskt meddelande klockan 12:11:38.077312(UTC+1). Värdepappersföretag X behandlar detta meddelande automatiskt och använder sin algoritm som inger ordern till handelsplats M klockan 12:11:38.236931(UTC+1). Handelsplats M erhåller ordern klockan 12:11:38.478598(UTC+1)

(order 1). Värdepappersföretag X använder sig av teknik för algoritmisk högfrequenshandel i den mening som avses i artikel 4.1.40 i direktiv (EU) 2014/65 (MiFID II) med avseende på denna order.

Den 20 juni 2018 inger värdepappersföretag Y en order för ett kontant aktieinstrument till handelsplats M klockan 13:42:29.327087 (UTC+1). Handelsplats M tar emot ordern klockan 13:42:29.561123 (UTC+1) (order 2). Värdepappersföretag Y använder ett elektroniskt system som inte omfattas av definitionen i artikel 4.1.40 i direktiv (EU) 2014/65 (MiFID II).

Latenstiden från gateway till gateway för handelsplats M:s elektroniska matchningsmekanism är 350 mikrosekunder.

Artikel 25 i MiFIR och artikel 17 i MiFID II – registrering av orderdata

Handelsplats M ska registrera orderhändelsen med en granularitet i mikrosekunder eller bättre eftersom dess latenstid från gateway till gateway är mindre än en millisekund. För order 1 ska 2018-06-20T11:11:38.478598Z anges i fält 9 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 och för order 2 ska 2018-06-20T12:42:29.561123Z anges i fält 9 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580.

Värdepappersföretag X ska registrera orderhändelsen med en granularitet i mikrosekunder eller mer noggrant eftersom den genererades genom att värdepappersföretag X använde sig av teknik för algoritmisk högfrequenshandel (se tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574). Den tidsstämpel som används för mottagandet av kundordern ska vara 2018-06-20T11:11:38.077312Z. Tidsstämpeln som används för när ordern ingavs till handelsplatsen ska vara 2018-06-20T11:11:38.236931Z.

Värdepappersföretag Y ska registrera orderhändelsen med en granularitet i mikrosekunder eller bättre, eftersom den genererades genom elektronisk handel som omfattas av den sista raden i tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 såsom "annan handelsverksamhet". Tidsstämpeln ska vara 2018-06-20T12:42:29.327Z.

Artikel 26 i MiFIR – transaktionsrapportering

Om order från värdepappersföretag X och värdepappersföretag Y utfördes på handelsplats M är både företag X och företag Y skyldiga att inge transaktionsrapporter.

Värdepappersföretag X ska fylla i fält 28 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (datum och tidpunkt för handel) med en granularitet i mikrosekunder eller bättre för den transaktionsrapport som visar utförandet på marknaden. Värdepappersföretag Y ska använda en granularitet i millisekunder eller bättre för den transaktionsrapportering som visar utförandet på marknaden.

Exempel 146: Transaktioner som inte utförs på en handelsplats

Fortsättning på exempel 145: Om värdepappersföretag X förvärvade det kontanta aktieinstrumentet på handelsplats A och sedan sålde instrumentet till sin kund är värdepappersföretag X skyldigt att inge en transaktionsrapport. Enligt fält 28 "datum och tidpunkt för handel" i tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ska värdepappersföretag X ange datum och tidpunkt för handel på sin transaktionsrapport med en granularitet i sekunder eller bättre.

Exempel 147: Order och transaktioner på en handelsplats

Värdepappersföretag X inger en order för ett globalt depåbevis på handelsplats A den 20 juni 2018 klockan 15:01:25.369310(UTC+1), som tas emot av handelsplats A klockan 15:01:25.458482.

I det här fallet används en annan elektronisk matchningsmekanism på handelsplats A än i exempel 116. Denna matchningsmekanism har en latenstid från gateway till gateway på 1,2 millisekunder.

Värdepappersföretag X använder ett elektroniskt system som inte omfattas av definitionen i artikel 4.1.40 i MiFID II för att inge ordern.

Artikel 25 i MiFIR och artikel 17 i MiFID II – registrering av orderdata

Handelsplats A ska registrera orderhändelsen med en granularitet i millisekunder eller bättre eftersom dess latenstid från gateway till gateway överstiger 1 millisekund. Fält 9 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 ska fyllas i med 2018-06-20T14:01:25.458Z.

Värdepappersföretag X ska registrera orderhändelsen med en granularitet i millisekunder eller bättre eftersom den genererades genom elektronisk handel som omfattas av den sista raden i tabell 2 i bilagan till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 såsom "annan handelsverksamhet". Tidsstämpeln ska vara 2018-06-20T14:01:25.369Z.

Artikel 26 i MiFIR – transaktionsrapportering

Om ordern från värdepappersföretag X utfördes på handelsplats A ska värdepappersföretag X fylla i fält 28 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 (datum och tidpunkt för handel) med en granularitet i mikrosekunder eller bättre för den transaktionsrapport som visar utförandet på marknaden.

För en kedja med ett slutgiltigt utförande på en handelsplats krävs enbart att marknadssidan av rapporten på handelsplatsen rapporteras med den granularitet som föreskrivs i artikel 3 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574. För de andra rapporterna krävs enbart en rapportering i sekunder även om en högre granularitet får rapporteras. Värdepappersföretag som inger order till andra företag kan rapportera den tid för utförande som rekommenderats av det utförande företaget genom röstmeddelande eller elektroniskt meddelande i fältet avseende datum och tidpunkt för handel.

7.3 Efterlevnad av kraven på största godtagbara avvikelse

I kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 fastställs två typer av noggrannhetskrav, nämligen maximal avvikelse från UTC och granularitet för tidsstämplar. Detta avsnitt av riktlinjerna gäller enbart det förstnämnda kravet. I artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 föreskrivs att "[d]en som driver handelsplatser och deras medlemmar eller deltagare ska införa ett system för spårbarhet till UTC". Detta omfattar säkerställande av att deras system fungerar med den granularitet och den maximala avvikelse från UTC som tolereras enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574. Vidare ska handelsplatsoperatörer och deras medlemmar och deltagare visa att de aktuella systemkomponenter som används för att uppfylla noggrannheten vad gäller standardnivåerna för granularitet och den maximala avvikelsen från UTC, såsom garanteras och specificeras av tillverkare av sådana systemkomponenter, installeras i överensstämmelse med tillverkarens installationsanvisningar.

Relevant och proportionerlig provning av systemet krävs samt relevant och proportionerlig övervakning av provningen för att säkerställa att avvikelsen från UTC ligger inom toleransnivån. Relevansen och proportionaliteten är avhängig den tillämpliga maximala avvikelsen från UTC.

Enligt artikel 1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 anses system som tillhandahåller en direkt spårbarhet till UTC-tiden som utfärdas och underhålls av ett tidscentra som är förtecknat i BIPM:s årsrapport om tidsaktiviteter kunna godtas för att registrera händelser som ska rapporteras. Användning av tidskällor från det amerikanska GPS-systemet, eller något annat globalt satellitsystem för navigation såsom det ryska GLONASS eller det europeiska Galileo-satellitsystemet när det tas i drift, är också godkända för registrering av händelser som ska rapporteras, under förutsättning att avvikelser från UTC redovisas och raderas från tidsstämpeln. GPS-tiden skiljer sig från UTC. Däremot omfattar GPS-tidsmeddelandet en avvikelse från UTC (skottsekunderna) och denna avvikelse ska kombineras med GPS-tidsstämpeln för att tillhandahålla en tidsstämpel som överensstämmer med kraven på maximal avvikelse i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574. Användare av sådana system ska vara medvetna om de relevanta risker som är förknippade med deras användning, såsom solstormar, störningar, reflektioner av signaler som tar olika vägar och att mottagaren är låst till signalen på ett korrekt sätt. Därför ska korrekta åtgärder vidtas för att säkerställa att dessa risker minimeras. Särskilt Internationella teleunionens rekommendation TF.1876 från undergruppen radiokommunikation (ITU-R) om tillförlitliga tidskällor⁵⁰ ska beaktas av enheter som planerar att använda GPS-mottagare som är föremål för de strängare noggrannhetskraven.

Enligt artikel 4 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 ska den noggrannhet som krävs enligt standarden vara tillämplig vid varje tillfälle inom gränserna för domänssystemet när tiden mäts för användare av satellitsystem. Emellertid är den första punkt för vilken systemets design, funktion och specifikationer ska beaktas den mottagare som används (dvs. modellen på GPS-mottagaren och den noggrannhet som mottagaren är utformad för) för att erhålla tidsstämpelmeddelandet från satelliten (och eventuella tillhörande antenner). Detta omfattar inte GPS-satellitsystemet och satellitens spårbarhet till UTC.

7.3.1 Skottsekunder

När en skottsekund ska läggas till eller dras ifrån från UTC såsom då och då tillkännages av IERS (International Earth Rotation and Reference Systems Service) ska detta göras i enlighet med ITU-R:s rekommendation TF.460-6. I rekommendationen anges att en positiv skottsekund börjar klockan 23:59:60 och slutar klockan 00:00:00, och att vid en negativ skottsekund flyttas tiden från 23:59:58 till 00:00:00.

7.3.2 Lokal tid och avvikelse från UTC

Tidsstämplar kan bibehållas i lokal tid så länge de omvandlas till (UTC) Greenwichtid när uppgifterna tillhandahålls behöriga myndigheter. Vissa tidsstämpelmeddelanden kan bestå av en tidsstämpel och en avvikelse från UTC som är tillämplig för den tidsstämpeln. Återigen, vad gäller tidsstämplar som tillhandahålls en behörig myndighet ska avvikelserna tillämpas på tidsstämpeln så att endast en tidsstämpel tillhandahålls den behöriga myndigheten.

7.3.3 Tillämpning på värdepappersföretag som inte är direkta medlemmar eller deltagare i handelsplatsen

Artikel 50 i MiFID II är enbart tillämplig på handelsplatser och deras medlemmar eller deltagare. Emellertid är kraven enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/589, MiFIR och artikel 16.6

⁵⁰ Rekommendation TF.1876-0 (04/2010), tillgänglig på <https://www.itu.int/rec/R-REC-TF.1876-0-201004-I/en>.

i MiFID II tillämpliga på värdepappersföretag oberoende av huruvida de handlar som medlemmar eller deltagare i en handelsplats. Hänvisningen till kraven på största godtagbara avvikelse i dessa båda bestämmelser ska förstås så att den endast är tillämplig på värdepappersföretagen när de handlar som medlemmar eller deltagare i handelsplatser, eftersom detta överensstämmer med omfattningen av den skyldighet som definieras i texten i nivå 1.

7.4 Tillämpnings- och värdtidsstämplar samt elektroniska tidsstämplar

Tillämpnings- och värdtidsstämplar genereras inom programvaran medan elektroniska tidsstämplar genereras genom separat maskinvara samtidigt som en kopia tas på de nätverkspaket som innehåller den informationen. Esma anser att medlemmar eller deltagare kan använda vilken som helst av dessa tidsstämplar. Handelsplatser ska observera att det beroende på kraven att registrera händelser i matchningsmekanismen troligen kommer att krävas användning av tillämpningstidsstämplar.

7.5 Latens från gateway till gateway

Handelsplatser kan registrera flera latenstider från gateway till gateway för olika percentiler. Vad gäller klocksynchronisering anser Esma att handelsplatser ska använda latenstiden för percentilen 99.

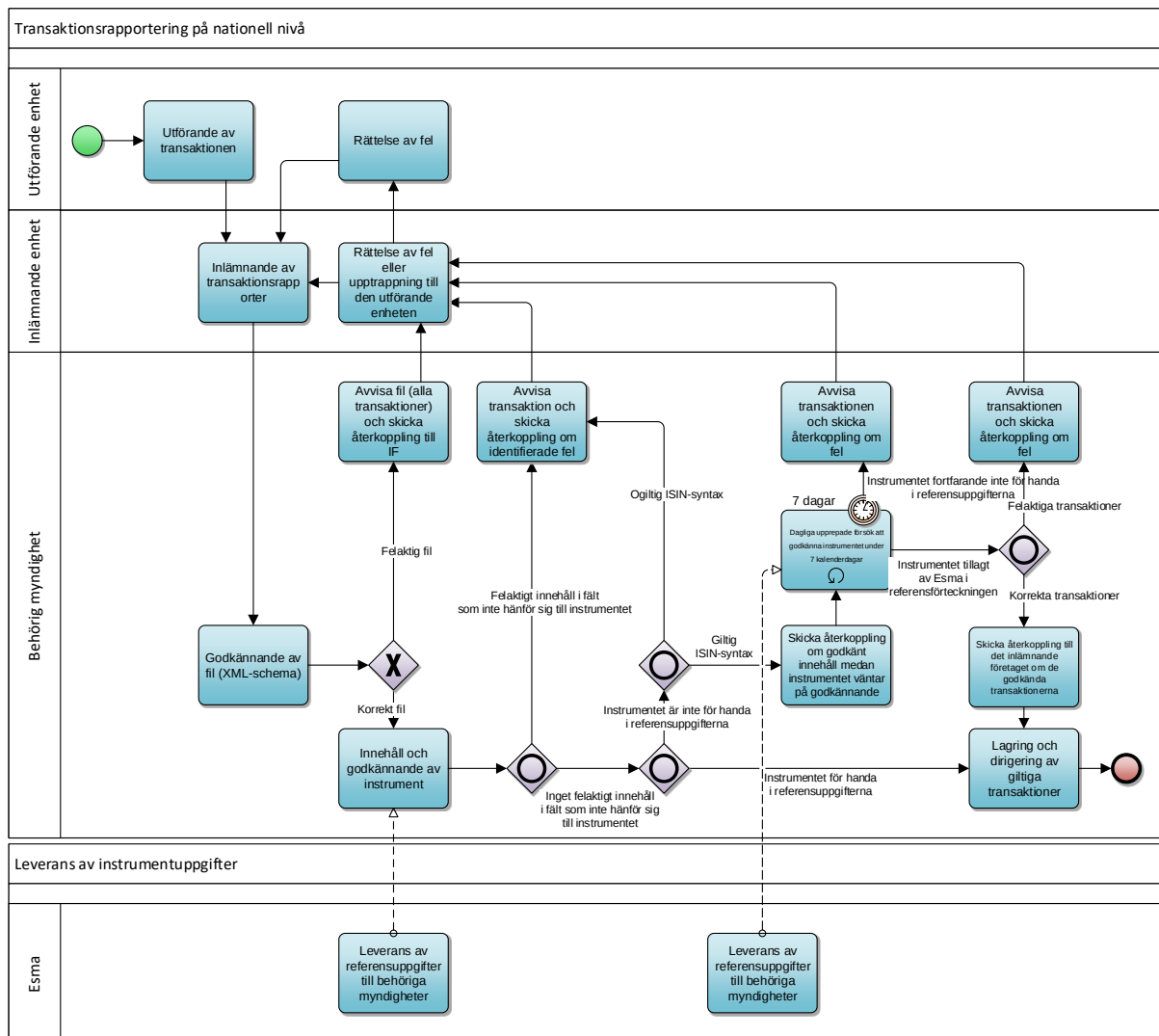
Handelsplatser är skyldiga att övervaka latensen från gateway till gateway i realtid enligt artikel 13 c (ESMA/2015/1464)⁵¹. Om latensen från gateway till gateway ökar från över en mikrosekund till mindre eller lika med en millisekund ändras kraven enligt artikel 50 på granularitet och maximal avvikelse. Detta scenario inträffar med största sannolikhet efter ett byte till en ny matchningsmekanism eller tekniska förbättringar av en handelsplats befintliga infrastruktur, och därför ska kraven på tidsstämpel beaktas när sådant arbete planeras.

8 Bilagor

Bilaga I Behandling av rapporter som erhålls från inlämnande enheter

I diagrammet nedan presenteras processen för transaktionsrapportering på nationell nivå:

⁵¹ KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/584 av den 14 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU avseende tekniska tillsynsstandarder som specificerar organisatoriska krav för handelsplatser.



I följande tabell sammanfattas tidsfristerna för de centrala händelserna i processen:

Notering	Uppgift	Frist
T	Utförande av transaktionen	
R	Inlämnande av transaktionsrapporter av den rapporterade enheten	T+1 arbetsdag
	Tillhandahållande av återkoppling till de rapporterade enheterna	R+1 kalenderdag (R+7 för instrument som saknas i referensuppgifterna)

Transaktioner som utförs dagen T ska inte rapporteras senare än vid stängning följande arbetsdag, dvs. T+1.

Det är upp till den behöriga myndigheten att fastställa detaljerade tekniska förfaranden och scheman för inlämnande av rapporter.

Behöriga myndigheter ska godkänna de inkommande rapporterna på följande sätt:

Godkännande av fil – bekräfta att filen överensstämmer med XML-mallen (syntax från hela filen och särskilda transaktionsrapporter). Om filen inte överensstämmer ska hela filen (alla transaktioner finns i filen) avvisas.

Godkännande av innehåll – ett antal valideringsregler som utförs för varje transaktionsrapport och verifierar innehållet i särskilda fält. Felaktiga transaktionsrapporter avvisas medan riktiga transaktioner behandlas i ytterligare steg. Dessa valideringsregler omfattar godkännande beroende på referensuppgifter för instrument.

Varje behörig myndighet ska tillämpa validering av filer. Dessa valideringsregler kontrollerar huruvida XML-filens syntax är korrekt.

Efter ett framgångsrikt godkännande av filen ska alla valideringsregler tillämpas på varje transaktionsrapport som är inkluderad i filen. Reglerna om innehåll innefattar särskilt validering av huruvida själva instrumentet eller det underliggande instrumentet (vad gäller vissa OTC-transaktioner eller transaktioner i derivatinstrument som genomförs på en organiserad plattform utanför unionen), för vilket transaktionen utfördes, omfattas av referensuppgifterna och huruvida den rapporterade ISIN-koden är korrekt vad gäller syntax/kontrollciffror. Följande situationer kan beaktas:

Om transaktionsrapporten är korrekt (alla regler för innehåll är ok) och det rapporterade instrumentet existerar i referensuppgifterna → transaktionsrapporten godkänns.

Om det inte finns något felaktigt innehåll som hänför sig till andra fält än instrument/underliggande, men det rapporterade instrumentet saknas i referensuppgifterna och syntaxen/kontrollciffrorna från den rapporterade ISIN är korrekt → ska följande åtgärder vidtas:

Den behöriga myndigheten ska informera det inlämnande företaget om att transaktionen väntar på godkännande av instrumentet.

Den behöriga myndigheten ska genomföra valideringen av instrumentet varje dag fram till den sjunde kalenderdagen efter att den erhöll rapporten från det inlämnande företaget.

Om instrumentet blir tillgängligt i referensuppgifterna innan det har gått sju kalenderdagar och det inte finns något felaktigt innehåll som beror på valideringen av instrumentet ska transaktionen godkännas.

Om instrumentet blir tillgängligt i referensuppgifterna innan det har gått sju kalenderdagar och det finns felaktigt innehåll som beror på valideringen av instrumentet ska transaktionen avvisas.

Om instrumentet fortfarande inte är tillgängligt i referensuppgifterna efter sju kalenderdagar ska den behöriga myndigheten avvisa transaktionsrapporten och skicka relevant meddelande till det inlämnande företaget.

Om det inte finns något felaktigt innehåll som avser andra fält än instrument/underliggande, men det rapporterade instrumentet saknas i referensuppgifterna och kontrollciffrorna från den rapporterade ISIN är felaktiga → ska transaktionen avvisas omedelbart.

Om det finns felaktigt innehåll som avser andra fält än instrument/underliggande → ska transaktionen avvisas omedelbart, dvs. utan att vänta i ytterligare sju dagar. Återkoppling ska ges om alla fel som identifierats.

Godkännande av innehåll tillämpas endast på filer som har godkänts på filnivå. Var och en av valideringsreglerna ska tillämpas på varje transaktionsrapport i filen.

Om en transaktionsrapport inte överensstämmer med en eller flera valideringsregler ska denna rapport avvisas. Rapporter som överensstämmer med valideringsreglerna ska godkännas. Det är möjligt att vissa transaktionsrapporter som är inkluderade i en fil godkänns och vissa avvisas. Mot bakgrund av artikel 26.7 sista stycket i MiFIR ska den inlämnande enheten omedelbart vidta åtgärder för att säkerställa att misstag rättas utan dröjsmål. För godkännande av transaktioner som utförs dag T ska behöriga myndigheter använda referensuppgifter från dag T. För att kunna hantera frågor med anknytning till sen rapportering av transaktioner eller referensuppgifter, för transaktioner som godkänns eller dirigeras senare än T+1 ska behöriga myndigheter använda de senaste referensuppgifter som är tillgängliga den dag godkännandet genomfördes, dvs. om en transaktion som utfördes dag T erhålls från värdepappersföretaget dag T+10, ska denna transaktion godkännas med användning av de senaste referensuppgifter som var tillgängliga dagen för godkännandet.

Återkoppling ska göras och skickas till inlämnande enheter senast en dag efter ingivandet av rapporten (dvs. R+1 där R är rapporteringsdagen). Detta innefattar bekräftelser av korrekt ingivande av transaktionsrapporter samt felmeddelanden i det fall inlämnade transaktionsrapporter eller hela filer är felaktiga. Om en transaktionsrapport avvisas ska de valideringsregler som har tillämpats och felets natur specificeras i meddelandet om återkoppling.