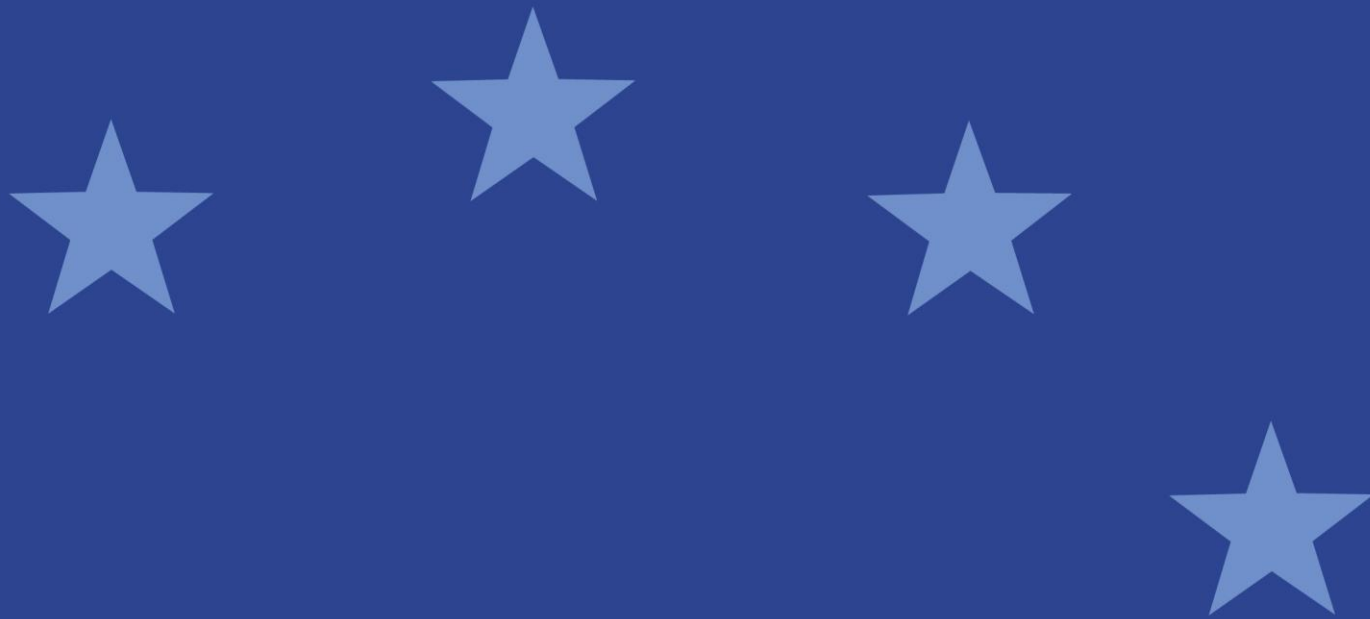


Obecné pokyny

**Hlášení obchodů, vedení záznamů o pokynech a synchronizace obchodních hodin
podle směrnice MiFID II**



Contents

Shrnutí	9
1 Oblast působnosti.....	10
2 Definice	10
3 Účel.....	10
4 Dodržování pokynů a oznamovací povinnost	11
5 Obecné pokyny k hlášení obchodů.....	11
Část I – Obecné zásady	14
5.1 Obecný přístup k předkládání hlášení	14
5.2 Postavení	15
5.2.1 Obchodování na vlastní účet (DEAL)	15
5.2.2 Obchodování párováním pokynů na vlastní účet (MTCH)	19
5.2.3 Obchodování v „jakémkoli jiném postavení“ (AOTC)	20
5.2.4 Omezení postavení	21
5.3 Řetězce a předávání	21
5.3.1 Obecně	21
5.3.2 Řetězec, kdy podnik obchoduje na svůj vlastní účet nebo párováním pokynů na vlastní účet.....	22
5.3.3 Předávání.....	22
5.4 Provádění obchodu v obchodním systému.....	23
5.4.1 Identifikační kód obchodů v obchodním systému (pole 3)	24
5.4.2 Ohlašování pole Systém pro řetězce (pole 36).....	24
5.5 Identifikační kódy stran	24
5.5.1 Postup při generování CONCAT	25
5.5.2 Jméno (jména) a příjmení.....	27
5.6 Význam pojmu „obchod“	27
5.6.1 Nabytí a pozbytí	27
5.6.2 Vyloučení z hlášení	28
5.7 Mechanismus hlášení.....	32
5.7.1 Pole, které nelze vyplnit, a vyplňování polí referenčními údaji.....	32
5.7.2 Předkládání hlášení o obchodech	33
Část II – Bloky	34
5.8 Blok 1: Identifikace kupujícího/prodávajícího	34

5.8.1	Kupující/prodávající, který je způsobilý k LEI.....	34
5.8.2	Kupující/prodávající je fyzická osoba.....	35
5.9	Blok 2: Subjekt s rozhodovací pravomocí za kupujícího/prodávajícího	38
5.9.1	Subjektem s rozhodovací pravomocí je kupující/prodávající.....	39
5.9.2	Subjektem s rozhodovací pravomocí je třetí strana s oprávněním k zastupování kupujícího/prodávajícího.....	40
5.10	Blok 3 (kombinace 1 a 2): Konkrétní scénáře pro kupujícího/prodávajícího a subjekt s rozhodovací pravomocí.....	42
5.10.1	Kupující/prodávající mají společný účet.....	42
5.10.2	Prodávající zesnul.....	43
5.11	Blok 4: Pole Investiční rozhodnutí v rámci podniku.....	43
5.11.1	Pole Investiční rozhodnutí v rámci podniku	43
5.11.2	Investiční rozhodnutí učiněné mimo podnik (zákazník učiní investiční rozhodnutí a investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet nebo jedná v „jakémkoli jiném postavení“).....	44
5.12	Blok 5: Pole Provedení obchodu v rámci podniku.....	45
5.12.1	Primární odpovědnost za provedení má osoba	46
5.12.2	Primární odpovědnost za provedení má algoritmus.....	46
5.13	Blok 6: Datum a čas obchodování	46
5.14	Blok 7: Systém	46
5.14.1	Provedení obchodu v obchodním systému v anonymní knize pokynů	47
5.14.2	Provádění obchodu na obchodní platformě mimo Unii v neanonymní knize pokynů 48	
5.14.3	Provedení obchodu v obchodním systému výběrem svého vlastního pokynu v anonymní knize pokynů	49
5.14.4	Systematický internalizátor provádějící obchod	50
5.15	Blok 8: Příznak prodeje na krátko.....	51
5.15.1	Zákazník Investičního podniku X prodává na krátko (informace známá podniku X) 52	
5.15.2	Investiční podnik X prodává na krátko svým vlastním jménem	52
5.16	Blok 9: Ukazatele výjimky, poobchodní ukazatele OTC a ukazatele komoditních derivativů	54
5.16.1	Ukazatel výjimky a poobchodní ukazatel OTC.....	54
5.16.2	Poobchodní ukazatel, pokud investiční podnik páruje dva pokyny zákazníka mimoburzovně.....	58
5.16.3	Ukazatel komoditního derivátu	58

5.17	Blok 10: Pobočky	59
5.17.1	Obchod provedený na účet zákazníka	59
5.17.2	Obchod provedený na vlastní účet	62
5.17.3	Obchod prováděný pobočkami v Evropském hospodářském prostoru u podniků mimo Evropský hospodářský prostor.....	63
5.18	Blok 11: Status hlášení o obchodech a oprav.....	65
5.18.1	Rušení a změny během dne.....	65
5.18.2	Předložení nového hlášení o obchodu	66
5.18.3	Předložení zrušení	66
5.18.4	Oprava informací v hlášení o obchodu	67
5.19	Blok 12: Změna pomyslné hodnoty	69
5.19.1	Navýšení pomyslné hodnoty	69
5.19.2	Snížení pomyslné hodnoty	72
5.19.3	Úplné předčasné ukončení.....	73
	Část III – Obchodní scénáře	74
5.20	Převod cenných papírů	74
5.20.1	Převod mezi zákazníky v rámci stejného podniku	74
5.20.2	Převody mezi zákazníky dvou samostatných investičních podniků.....	75
5.20.3	Podniky jednající mimoburzovně při párování pokynů dvou zákazníků	77
5.21	Investiční podnik představující bez vstupování.....	79
5.21.1	Investiční podnik páruje dva pokyny od zákazníků bez toho, aniž by mezi ně vstoupil	79
5.21.2	Investiční podnik představující svého zákazníka jinému investičnímu podniku, aniž by mezi ně vstupoval	80
5.22	Jeden pokyn jednoho zákazníka prováděný ve více obchodech	81
5.22.1	Provedení pokynu zákazníka provedením v systému a poté poskytnutím zákazníkovi z vlastního portfolia investičního podniku	81
5.22.2	Provedení pokynu zákazníka získáním části ze systému a poskytnutím nástrojů zákazníkovi z vlastního portfolia investičního podniku	84
5.23	Seskupování pokynů	86
5.23.1	Jedno provedení na trhu za několik zákazníků	87
5.23.2	Několik provedení na trhu za několik zákazníků	90
5.24	OTF obchodující párováním pokynů na vlastní účet.....	104
5.25	Obchody s vyrovnávací jednotkou na základě hodnoty	109
5.26	Řetězce a předávání	112

5.26.1	Řetězce, kdy nejsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b).....	113
5.26.2	Řetězce, kdy jsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b), ale nejsou splněny všechny ostatní podmínky stanovené v článku 4.....	116
5.26.3	Řetězce, kdy jsou podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 splněny všemi investičními podniky.....	125
5.26.4	Řetězce, kdy jsou podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 splněny některými investičními podniky v řetězci.....	133
5.27	Investiční podnik jednající na základě diskrečního pověření za více zákazníků....	146
5.27.1	Investiční podnik jednající na základě diskrečního pověření za více zákazníků bez splnění podmínek pro předání (kombinace sdružených pokynů a řetězců/předání)	146
5.27.2	Investiční správce, který jedná na základě diskrečního pověření za více zákazníků a splňuje podmínky pro předání.....	158
5.28	Přímý elektronický přístup (DEA).....	166
5.28.1	Scénář 1: zákazník DEA obchoduje na vlastní účet bez základního zákazníka	167
5.28.2	Scénář č. 2: Zákazník DEA jedná na účet zákazníka	169
5.29	Zajištění prostřednictvím rozdílových smluv (CFD).....	172
5.30	Hlášení předložené obchodním systémem o obchodu provedeném prostřednictvím jeho systémů podle čl. 26 odst. 5 nařízení MiFIR.....	174
5.30.1	Podnik obchoduje na vlastní účet.....	175
5.30.2	Podnik obchoduje „párováním pokynů na vlastní účet“ nebo v „jakémkoli jiném postavení“ za jednoho zákazníka	176
5.30.3	Podnik shrnuje pokyny od několika zákazníků.....	177
5.31	Obchody zajišťující financování.....	179
Část IV – Hlášení různých typů nástrojů		180
5.32	Zásady	180
5.33	Identifikace finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému nebo dostupných v seznamu ESMA	181
5.34	Identifikace finančních nástrojů neobchodovaných v obchodním systému nebo nedostupných v seznamu ESMA	181
5.34.1	Finanční nástroje obchodované na organizované obchodní platformě mimo Unii (systém mimo Evropský hospodářský prostor)	181
5.34.2	OTC deriváty.....	182
5.35	Hlášení specifických finančních nástrojů	183
5.35.1	Akciové nástroje nebo nástroje podobné akciovým	183
5.35.2	Dluhopisy a jiné formy dluhových cenných papírů	184

5.35.3	Opce	191
5.35.4	Rozdílová smlouva	194
5.35.5	Sázka na spready	195
5.35.6	Swapy úvěrového selhání	201
5.35.7	Swapy	203
	Cena vyplněná v poli 33 musí být konzistentní s hodnotou pevné sazby v referenčních údajích o nástroji.	219
5.35.8	Komoditní deriváty	219
5.35.9	Komplexní obchody	225
6	Obecné pokyny k vedení záznamů o pokynech	228
	Část I – Obecné zásady	228
6.1	Oblast působnosti požadavků na vedení záznamů o pokynech	228
6.2	Členové nebo účastníci obchodního systému	228
6.3	Identifikační kód zákazníka (pole 3)	229
6.3.1	Vyplnění pole 3 (Identifikační kód zákazníka) v případě sdružených pokynů	229
6.3.2	Vyplnění pole 3 (Identifikační kód zákazníka) v případě neprovedených alokací 230	
6.4	Makléř neprovádějící pokyny (pole 6)	230
6.5	Stav pokynu (pole 33)	230
6.6	Datum a čas doby platnosti (pole 12)	231
6.7	Indikátor pasivního nebo agresivního pokynu (pole 44)	231
6.8	Identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) (pole 48)	231
6.9	Pořadové číslo (pole 15)	231
6.10	Doba platnosti (pole 10)	234
6.10.1	Příznak Good-For-Day (DAVY)	234
6.10.2	Kombinace dvou příznaků doby platnosti: Good-After-Date (GADV) a Good-Till-Date (GTDV)	235
6.11	Poskytování likvidity (pole 8)	236
	Část II – Scénáře	237
6.12	Legenda	237
6.13	Central Limit Order Book	237
6.13.1	Nový pokyn / zrušení / změna pokynů (pole 21)	238
6.13.2	Další limitní cena (pole 25)	241
6.13.3	Klasifikace limitního pokynu iceberg	242
6.13.4	Pokyny peg (vázané)	244

6.13.5	Klasifikace pokynu Stop	248
6.13.6	Směřované pokyny	250
6.13.7	Klasifikace strategických pokynů (pole 46)	256
6.13.8	Změna priority	270
6.13.9	Fáze obchodování	273
6.14	Systémy žádostí o kotace	283
6.14.1	Jak zaznamenat žádost o kotaci, která je poslána konkrétním protistranám ..	283
6.14.2	Jak zaznamenat reakci na kotaci s omezenou dobou platnosti („on the wire time“), která je proveditelná pouze pro konkrétního žadatele o kotaci	284
6.14.3	Jak zaznamenat reakci na kotaci s odlišným množstvím, než bylo požadováno. 285	
6.14.4	Jak zaznamenat provedení v systému žádostí o kotace	286
7	Obecné pokyny k synchronizaci obchodních hodin	288
7.1	Události, které musí být nahlášeny	288
7.2	Podrobnost časového razítka	288
7.3	Dodržení požadavků na maximální odchylku	291
7.3.1	Přestupné sekundy	292
7.3.2	Místní čas a odchylka od UTC	292
7.3.3	Platnost pro investiční podniky, které nejsou přímými členy ani účastníky obchodního systému	293
7.4	Aplikační, hostitelská a „drátová“ časová razítka	293
7.5	Latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu	293
8	Přílohy	294
	Příloha I Zpracování hlášení přijatých od předkládajících subjektů	294

Shrnutí

Důvody zveřejnění

Po dokončení návrhu regulačních technických norem (RTS) pro hlášení obchodů, vedení záznamů o pokynech a synchronizace obchodních hodin (nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574¹) zahájila ESMA z vlastní iniciativy práci týkající se opatření pro sblížení dohledu při provádění těchto RTS.

Tyto obecné pokyny odrážejí výsledky této práce a navazují na konzultační dokument, který byl zveřejněn v prosinci 2015².

Obsah

Oddíly 1, 2 a 3 vymezují působnost, definice a účel těchto obecných pokynů. Oddíl 4 vymezuje postup pro dodržování těchto obecných pokynů. Oddíly 5 a 6 stanoví jednotlivé scénáře relevantní pro daný obchod a činnosti související s vedením záznamů o pokynech. Každý ze scénářů doprovází přesná technická programová instrukce, která se použije k uvedení konkrétních hodnot, které se mají hlásit. Kromě scénářů pro hlášení a vedení záznamů poskytují tyto oddíly také řadu dalších objasnění ohledně uplatňování požadavků podle nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580, o která žádali účastníci trhu během konzultací k těmto RTS, ale která nemohla být vzhledem k úrovni podrobnosti a specifičnosti těchto žádostí v konečných technických normách uvedena. Oddíl 7 objasňuje uplatňování požadavků na synchronizaci obchodních hodin (nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574).

¹ Návrh technických norem ESMA předložený Evropské komisi dne 28. září 2015 (ESMA/2015/1464) je k dispozici na internetových stránkách ESMA pod následujícím odkazem: 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 Konzultační dokument týkající se Obecných pokynů k hlášení obchodů, referenčním údajům, vedení záznamů o pokynech a synchronizaci obchodních hodin (ESMA/2015/1909) je k dispozici na internetových stránkách ESMA pod následujícím odkazem: 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 Oblast působnosti

Dotčené subjekty

Tyto obecné pokyny platí pro investiční podniky, obchodní systémy, schválené mechanismy pro hlášení obchodů (ARM) a příslušné orgány (CA).

Předmět

Tyto obecné pokyny se vztahují na předkládání hlášení o obchodech podle článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014 Evropského parlamentu a Rady (MiFIR)³, vedení záznamů o pokynech podle článku 25 nařízení MiFIR a synchronizaci obchodních hodin podle článku 50 směrnice 2014/65/EU Evropského parlamentu a Rady (MiFID II)⁴.

Časový rámec

Tyto obecné pokyny se použijí od 3. ledna 2018.

2 Definice

Pojmy používané ve směrnici MiFID II a nařízení MiFIR Evropského parlamentu a Rady mají v těchto obecných pokynech stejný význam. Kromě toho odkazy na „podnik“ v těchto obecných pokynech odkazují na jakýkoli podnik, který není „investičním podnikem“ ve smyslu směrnice MiFID II, není-li uvedeno jinak.

Odkazy na konkrétní „pole“ v obecných pokynech k hlášení obchodů odkazují na pole v tabulce 2 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590⁵ a v pokynech k vedení záznamů na pole v tabulce 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580⁶.

3 Účel

Účelem těchto obecných pokynů je poskytnout investičním podnikům⁷, obchodním systémům⁸, schváleným mechanismům pro hlášení obchodů⁹ a systematickým internalizátorům (SI)¹⁰ vodítko, pokud jde o dodržování ustanovení o předkládání hlášení a vedení záznamů o pokynech v nařízení

³ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84).

⁴ Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně směrnic 2002/92/ES a 2011/61/EU (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

⁵ NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům. K dispozici prostřednictvím následujícího odkazu:

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 NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU) 2017/580 ze dne 24. června 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro uchovávání příslušných údajů o pokynech týkajících se finančních nástrojů. K dispozici prostřednictvím následujícího odkazu:

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 Jak je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 1 směrnice MiFID II.

⁸ Jak je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 24 směrnice MiFID II.

⁹ Jak je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 54 směrnice MiFID II.

¹⁰ Jak je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 20 směrnice MiFID II.

MiFIR a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574¹¹. Slouží k zajištění konzistence při uplatňování těchto požadavků. Toto vodítko se zaměřuje zejména na sestavování hlášení o obchodech a datových záznamů o pokynech pole po poli pro různé scénáře, které se mohou vyskytnout. Vzhledem k široké škále možných scénářů neuvádějí tyto obecné pokyny vyčerpávající seznam všech scénářů. Osoby, na které se tyto obecné pokyny vztahují, musí při sestavování záznamů a hlášení použít prvky nejrelevantnějšího scénáře. Všechny pojmy uvedené v tomto dokumentu s pokyny se týkají pouze článku 25 nařízení MiFIR o povinnostech vést datové záznamy o pokynech, článku 26 nařízení MiFIR o povinnostech hlásit obchody a článku 50 o synchronizaci obchodních hodin uvedených ve směrnici MiFID II.

Všechna jména a příjmení použitá v těchto obecných pokynech jsou fiktivní.

4 Dodržování pokynů a oznamovací povinnost

Status obecných pokynů

Tento dokument obsahuje obecné pokyny vydané podle článku 16 nařízení o orgánu ESMA. V souladu s čl. 16 odst. 3 nařízení o orgánu ESMA musí příslušné orgány a účastníci finančního trhu vynaložit veškeré úsilí, aby se obecnými pokyny a doporučeními řídili.

Příslušné orgány, na které se tyto obecné pokyny vztahují, by měly zajistit soulad s nimi tak, že je začlení do svých postupů dohledu, a to i tehdy, pokud jsou konkrétní pokyny v tomto dokumentu určeny primárně účastníkům finančního trhu.

Oznamovací povinnost

Příslušné orgány, na které se tyto obecné pokyny vztahují, jsou povinny orgánu ESMA na adresu MiFIRreportingGL@esma.europa.eu oznámit, zda se těmito obecnými pokyny řídí nebo hodlají řídit, a případně uvést důvody, proč se jimi neřídí nebo nehodlají řídit, a to do dvou měsíců od data zveřejnění obecných pokynů orgánem ESMA. Nebude-li odpověď poskytnuta v této lhůtě, bude se předpokládat, že se příslušné orgány těmito obecnými pokyny a doporučeními neřídí. Vzor oznámení je k dispozici na internetových stránkách orgánu ESMA.

Účastníci finančního trhu nejsou povinni oznamovat, zda se těmito obecnými pokyny řídí.

5 Obecné pokyny k hlášení obchodů

Tento oddíl o hlášení obchodů je rozdělen do čtyř částí:

- **Část I – Obecné zásady.** Popisuje obecné zásady, které platí pro hlášení obchodů. Uvádí, jak sestavit hlášení o obchodu a za jakých okolností a kam hlášení odeslat. Poskytuje přístupy na vysoké úrovni k předkládání hlášení a další vodítka k určitým výjimkám ve vztahu k obchodu uvedeným v čl. 2 odst. 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

¹¹ NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU) 2017/574 ze dne 7. června 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o regulační technické normy týkající se míry přesnosti obchodních hodin.

- **Část II – Bloky.** Popisuje bloky (soubor polí), kdy každý blok obsahuje příslušná pole týkající se konkrétního tématu, a uvádí příklady, jak je vyplnit. Bloky jsou strukturovány tak, aby byly navzájem nezávislé.
- **Část III – Scénáře.** Uvádí příklady na základě různých obchodních scénářů, které se mohou u strany předkládající hlášení vyskytnout. Jsou zde uvedeny zejména obchody plynoucí z předávání pokynů, sdružených pokynů a ustanovení přímého elektronického přístupu (DEA).
- **Část IV – Nástroje.** Zaměřuje se na vodítka k hlášení pro různé finanční nástroje¹². Většina příkladů se zaměřuje na deriváty, jelikož tyto finanční nástroje mají nejsložitější způsob hlášení.

Ke každému příkladu v tomto dokumentu je zde uvedena odpovídající tabulka s příslušnými poli a textovým formátem XML pro zadání těchto údajů. Odpovídající tabulka a XML by se měla vykládat následujícím způsobem, není-li uvedeno jinak:

- a) „Č.“ a „Pole“ odpovídají číslu a názvu pole v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, příloha I, tabulka 2.
- b) Sloupec „Hodnoty“ obsahuje očekávanou doslovnou hodnotu z příkladu. Doslovné hodnoty se vkládají do jednoduchých uvozovek. V některých případech se místo toho uvede popisná hodnota, např. „{LEI} podniku X“. Tyto hodnoty se nahradí skutečnou hodnotou odpovídající popisu. Tam, kde je to uvedeno, budou v XML použity hodnoty fiktivních subjektů z legendy. Pojmy v závorkách odkazují na datové typy popsané v tabulce 1 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.
- c) Prázdná místa ve sloupci „Hodnoty“ explicitně uvádějí, že tato pole nejsou pro konkrétní ilustrovaný scénář relevantní a nevyplňují se.

Úryvky textu XML jsou uvedeny pro názorný příklad, jak se tyto údaje uvádějí v souboru předkládaném příslušnému orgánu. Pro účely provádění metodiky ISO 20022 je však nutno nahlédnout do úplné technické specifikace zpráv a za správnou specifikaci zpráv se považuje pouze úplná technická specifikace, která je k dispozici na https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf.

Všechny nástroje uvedené v příkladech jsou finanční nástroje, které se musí hlásit podle čl. 26 odst. 2 nařízení MIFIR.

Předkládání hlášení je ukázáno pouze pro strany zkoumané v příslušném příkladu a nelze mít za to, že to znamená, že jiné strany v tomto příkladu nemají oznamovací povinnost ohledně obchodů.

Všechny časy jsou v UTC, není-li uvedeno jinak. Datum a čas jsou uvedeny s minimální podrobností vyžadovanou nařízením Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (příloha I, tabulka 2, pole 28) a mohou být hlášeny s vyšší úrovní podrobnosti, jak vysvětluje oddíl 7.2 o podrobnosti časového razítka.

Pro účely podrobnosti hlášeného času se u všech obchodů má za to, že se jedná o elektronické obchody, nikoliv o obchodování s vysokou frekvencí.

Není-li výslovně zmíněno jinak, investiční podniky, jejichž hlášení jsou zde uvedena, jednají v „jakémkoli jiném postavení“.

Legenda:

¹² Jak je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 15 směrnice MiFID II.

Podnik X (LEI: 12345678901234567890) je investiční podnik.
Podnik Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) je investiční podnik.
Podnik Z (LEI: 88888888888888888888) je investiční podnik.
Zákazník A (LEI: AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA) je právnická osoba.
Zákazník B (LEI: BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB) je právnická osoba.
Zákazník C (LEI: CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) je právnická osoba.

Obchodní systém M (segment MIC: ,XMIC'). Tento obchodní systém vede anonymní knihu pokynů u ústřední protistrany, která má LEI 11111111111111111111.

Zákazník 1: fyzická osoba Jean Cocteau, francouzský státní příslušník, datum narození 4. června 1962 (zřetězený kód: FR19620604JEAN#COCTE).

Zákazník 2: fyzická osoba Jose Luis Rodriguez de la Torre, španělský státní příslušník, datum narození 27. února 1976. Španělské daňové identifikační číslo pro Jose Luise Rodrigueze de la Torre je 99156722T.

Zástupce 1: fyzická osoba Fabio Luca, italský státní příslušník, daňové číslo ABCDEF1234567890 a datum narození 11. října 1974.

Obchodník 1: Peter Morgan, kanadský státní příslušník (číslo pasu 1112223334445555) zastupující Podnik X.

Obchodník 2: Peter Jones, státní příslušník Spojeného království, číslo národního pojištění Spojeného království AB123456C, zastupující Podnik X.

Obchodník 3: John Cross, belgický státní příslušník, vnitrostátní registrační číslo 12345678901, zastupující Podnik X.

Obchodník 4: Marie Claire, francouzská státní příslušnice, datum narození 2. prosince 1963 (zřetězený kód FR19631202MARIECLAIR), zastupující Podnik Y.

Obchodník 5: Juliet Stevens, finská státní příslušnice, osobní identifikační kód 311280-888Y, zastupující Podnik Z.

Obchodník 6: Adam Jones, maďarský státní příslušník, datum narození 13. dubna 1980 (zřetězený kód HU19800413ADAM#JONES), zastupující Podnik Z.

Aby se ušetřilo místo a aby bylo možné se soustředit na hlavní body znázorněné na příkladech, je důležité zdůraznit, že každý příklad se svou odpovídající tabulkou a XML se bude zabývat pouze podmnožinou polí skutečně vyžadovaných podle nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Nelze předpokládat, že pole, která nejsou v příkladu konkrétně uvedena, jsou irelevantní. Všechna pole, které jsou relevantní pro daný obchod, je nutno hlásit.

Aby se zajistilo správné hlášení obchodů, musí se tento dokument vykládat ve spojení s příslušnými ustanoveními směrnice MiFID II, nařízení MiFIR i nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. ESMA a příslušné orgány mohou rovněž vydat technické specifikace.

Část I – Obecné zásady

5.1 Obecný přístup k předkládání hlášení

Účelem hlášení obchodů je poskytnout příslušným orgánům informace o obchodech. Jeho cílem je poskytnout fakta o obchodu, která informují příslušný orgán o všech příslušných okolnostech, za kterých k obchodu došlo. Podle postavení investičního podniku a toho, zda investiční podnik zastupuje zákazníka, může být zapotřebí předložit více než jedno hlášení o obchodu.

Aby příslušné orgány splnily své povinnosti uvedené v bodě odůvodnění 32 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, vyžadují přesný a ucelený pohled na obchody, které spadají do oblasti působnosti oznamovací povinnosti podle článku 26 nařízení MiFIR. Jak uvádí bod odůvodnění 11 a dále čl. 15 odst. 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, investiční podnik by měl proto zajistit, aby souhrnný přehled hlášení o obchodech předložený investičním podnikem jako provádějícím subjektem přesně odrážel všechny změny jeho pozice a pozice jeho zákazníků, které vyplývají z hlášených obchodů¹³ s dotýcnými finančními nástroji v době, kdy byly obchody provedeny. Pokud například investiční podnik nabude některé finanční nástroje na vlastní účet a poté prodá stejné množství nástrojů svému zákazníkovi, hlášení předložená investičním podnikem musí uvádět, že čistá změna pro investiční podnik je neutrální a že nástroje získal zákazník. Tato zásada platí bez ohledu na to, zda některá nebo všechna hlášení předkládá samotný investiční podnik, schválený mechanismus pro hlášení obchodů nebo obchodní systém. Například investiční podnik, který se spoléhá na to, že informace o tržní straně u obchodu ohlásí obchodní systém, nepředkládá hlášení o obchodu pro stejný obchod na tržní straně. Je-li daný obchod za zákazníka, nepředkládá investiční podnik podle těchto obecných pokynů samostatné hlášení o obchodu pro daný obchod buď s obchodováním párováním pokynů na vlastní účet, nebo v „jakémkoli jiném postavení“, protože by tím uměle vzrostl počet obchodů hlášených jako provedených daným investičním podnikem. Dále by měla být jednotlivá hlášení investičního podniku pro daný obchod navzájem konzistentní a měla by přesně odrážet roli investičního podniku, jeho protistran, zákazníků a stran zastupujících zákazníky na základě oprávnění k zastupování.

Podle čl. 26 odst. 1 nařízení MiFIR investiční podniky, které provádějí obchody s finančními nástroji, hlásí úplné a přesné údaje o těchto obchodech. To znamená, že pokud spolu obchodují dva investiční podniky, každý z nich vypracuje svoje vlastní hlášení o obchodu, které odráží daný obchod z jeho vlastního pohledu. Současně se musí v příslušných ekvivalentních hlášeních každého z těchto dvou investičních podniků shodovat obsah následujících polí (popisujících společné objektivní prvky obchodu uzavřeného mezi těmito dvěma investičními podniky): systém¹⁴, datum a čas obchodování¹⁵, množství, měna množství, cena, měna, v níž je uvedena cena, platba předem, měna, v níž je uvedena platba předem a údaje o nástroji, je-li to relevantní.

Hlášení o obchodech předkládaná investičním podnikem obsahují nejen informace o tržní straně obchodu, ale také informace o související alokaci zákazníkovi, je-li to relevantní. Pokud například Investiční podnik X jednající na účet zákazníka nakoupí finanční nástroje od jiného podniku nebo

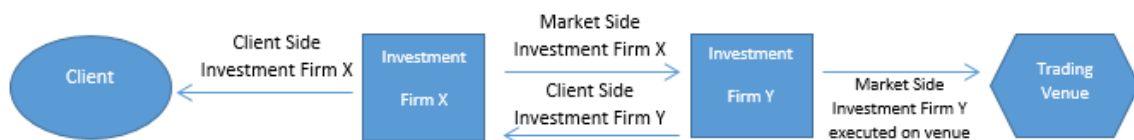
¹³ Je třeba podotknout, že oznamovací povinnost není určena k tomu, aby zachycovala aktuální pozici investičního podniku nebo zákazníka investičního podniku. Předmětem zájmu je změna pozice v důsledku hlášených obchodů.

¹⁴ U obchodů na tržní straně prováděných v obchodním systému (tj. jako protiklad k související alokaci zákazníkovi).

¹⁵ S výhradou různých požadavků na podrobnost relevantních pro investiční podniky – viz oddíl 7.2

investičního podniku Y, nahlásí X, že obchodoval s Y za zákazníka podniku X¹⁶. Pokud X nakupuje finanční nástroje na vlastní účet a prodá tyto finanční nástroje zákazníkovi, nahlásí nákup od Investičního podniku Y a prodej zákazníkovi ve dvou samostatných hlášeních o obchodech na vlastní účet. Podobně, pokud investiční podnik provede obchod s jiným podnikem nebo investičním podnikem seskupením několika zákazníků, nahlásí sdružený (blokový) obchod s daným podnikem nebo investičním podnikem (tržní strana) i jednotlivé alokace svým zákazníkům (strana zákazníka).

Pokud například investiční podnik obchoduje za zákazníka v obchodním systému na svůj vlastní účet, předloží dvě hlášení o obchodech: jedno za obchod s obchodním systémem (tržní strana) a druhé za obchod se zákazníkem (strana zákazníka). Pokud investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet nebo v „jakémkoli jiném postavení“ za jediného zákazníka, předloží jedno hlášení o obchodu, které zahrnuje tržní stranu i stranu zákazníka a které má vyplněny všechna pole vztahující se na daného zákazníka. Tyto koncepty znázorňuje následující schéma:



Client	Zákazník
Client Side	Strana zákazníka
Investment Firm X	Investiční podnik X
Market Side	Tržní strana
Investment Firm Y	Investiční podnik Y
Investment Firm Y executed on venue	Investiční podnik Y provedl v systému
Trading venue	Obchodní systém

5.2 Postavení

Jak stanoví nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (pole 29), existují tři různá postavení, která mohou být nahlášena: obchodování na vlastní účet, obchodování párováním pokynů na vlastní účet a „jakékoli jiné postavení“. Nahlášené postavení by mělo odrážet postavení, ve kterém investiční podnik skutečně obchodoval, a mělo by být konzistentní s ostatními informacemi uvedenými v hlášení (hlášeních) o obchodech investičního podniku.

5.2.1 Obchodování na vlastní účet (DEAL)

Pokud investiční podnik obchoduje na vlastní účet, je v hlášení o obchodu uveden buď jako kupující, nebo jako prodávající. Odpovídající prodávající nebo kupující bude protistranou nebo zákazníkem nebo

¹⁶ Pokud nesplní požadavky na předávání podle článku 4 Commission Delegated Regulation (EU) 2017/590 – viz oddíl 5.26.

obchodním systémem¹⁷, s nímž investiční podnik obchoduje. Investiční podnik může jednat výhradně tak, že realizuje své vlastní obchody, nebo může jednat na vlastní účet s cílem provádět pokyny, které obdržel od zákazníka. Ve druhém případě může být čas a datum obchodování u hlášení na straně zákazníka stejné jako u hlášení na tržní straně nebo by mohlo být pozdější a cena u hlášení na tržní straně a hlášení na straně zákazníka by mohla být stejná nebo by se mohla lišit.

5.2.1.1 Obchodování svým jménem

Příklad 1

Investiční podnik X obchodující na vlastní účet na proprietárním základě nakoupí finanční nástroje v Obchodním systému M.

Hlášení Investičního podniku X bude:

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	... <Buyr>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	<AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>
29	Postavení	„DEAL“	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx>

5.2.1.2 Obchodování za zákazníka

Příklad 2

¹⁷ Jak je uvedeno v bloku 7.

Investiční podnik X obdrží pokyn od zákazníka, Zákazníka A, k nákupu finančního nástroje. Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet zakoupením finančního nástroje v Obchodním systému M a prodejem těchto nástrojů Zákazníkovi A.

Jak bylo uvedeno výše, cena v různých hlášeních Investičního podniku X se může lišit, například Investiční podnik X může nakoupit od systému/protistrany za 0,352 GBP a prodat Zákazníkovi A za 0,370 GBP; v tomto případě nahlásí Investiční podnik X toto:

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
33	Cena	,0,352'	,0,370'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF' ¹⁸

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 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> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Tx> </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> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.37</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Tx> </pre>

¹⁸ Použití ,XOFF' v poli Systém viz oddíl 5.4.

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

Příklad 3

Investiční podnik X obdrží pokyn od zákazníka, Zákazníka A, k nákupu finančních nástrojů a provede pokyn ze svého vlastního portfolia.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </pre>
29	Postavení	‚DEAL‘	<pre> </Id> </pre>
36	Systém	‚XOFF‘	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>

5.2.2 Obchodování párováním pokynů na vlastní účet (MTCH)

Ustanovení čl. 4 odst. 1 bodu 38 směrnice MiFID II definuje obchodování párováním pokynů na vlastní účet jako „obchod, kdy se facilitátor vloží mezi prodávajícího a kupujícího v daném obchodě tak, že v průběhu jeho provádění není nikdy vystaven tržnímu riziku (...)“. Následně by se v tomto hlášení o obchodu mělo projevit, že u investičního podniku provádějícího obchod nedošlo v důsledku obchodu ke změně postavení.

V případě, že existuje pouze jeden zákazník, předloží se jedno hlášení o obchodu, které bude obsahovat informace o tržní straně i o straně zákazníka. Zákazník (zákazníci) se vyplní v poli kupující/prodávající, zatímco systém nebo protistrana se vyplní do pole prodávající/kupující. Pokud je zapojen více než jeden zákazník, může se použít souhrnný účet zákazníka (oddíl 5.23 o sdružování pokynů), který spojí tržní stranu s alokacemi každému zákazníkovi, jak uvádí příklad 61, a hlášení na straně zákazníka by mělo obsahovat všechna relevantní pole.

Příklad 4

Pokud obchod v prvním příkladu 5.2.1 proběhl v Obchodním systému M v 09:30:42.124356 dne 9. června 2018 za cenu 0,352 GBP a Investiční podnik X obchodoval párováním pokynů na vlastní účet, bude hlášení podniku X následující:

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	... <Buyr>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	<AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr>
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-09T09:30:42.124Z'	</Buyr> <Sellr>
29	Postavení	,MTCH'	<AcctOwnr> <Id>
33	Cena	,0,352'	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T09:30:42.124Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric>

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

5.2.3 Obchodování v „jakémkoli jiném postavení“ (AOTC)

Veškerá další činnost, která nespadá do definic obchodování na vlastní účet ani obchodování párováním pokynů na vlastní účet, se hlásí jako „jakékoli jiné postavení“, které zahrnuje to, že činnost probíhá jménem zákazníka.

Příklad 5

Investiční podnik X obchodující na účet Zákazníka A nakoupí finanční nástroje v Obchodním systému M. Obchod se uskutečnil v 09:30:42.124356 dne 9. června 2018 za cenu 0,352 GBP.

Jak vypadá hlášení Investičního podniku X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt> 2018-06-09T09:30:42.124Z </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	
28	Datum a čas obchodování	„2018-06-09T09:30:42.124Z“	
29	Postavení	„AOTC“	
33	Cena	„0,352“	
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	

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

Toto hlášení o obchodu je stejné jako hlášení o obchodu, které by bylo vytvořeno, pokud by Investiční podnik X obchodoval párováním pokynů na vlastní účet, až na vyplnění pole pro postavení.

5.2.4 Omezení postavení

Investiční podniky obchodující na vlastní účet nebo na základě párování pokynů na vlastní účet jednají přímo svým jménem a nemohou „předávat pokyny“ podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, protože všechny pokyny, které zadají jinému podniku nebo investičnímu podniku jsou jejich vlastní pokyny namísto předávaných pokynů přijatých od zákazníka nebo plynoucích z rozhodnutí získat nebo prodat finanční nástroj za zákazníka na základě diskrečního pověření. Proto pokud investiční podniky předávají pokyny, ale nesplňují podmínky pro předávání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, bude ESMA očekávat, že budou předkládat hlášení pouze v „jakémkoli jiném postavení“.

Jak je uvedeno v oddíle 5.28, poskytovatel DEA hlásí obchod jako jednatel v postavení AOTC nebo MTCH.

5.3 Řetězce a předávání

5.3.1 Obecně

Řetězec hlášení vznikne, pokud podnik nebo investiční podnik neprovede obchod sám, ale odešle pokyn k provedení jinému podniku nebo investičnímu podniku. Patří sem situace, kdy

- (i) podnik nebo investiční podnik pošle svůj vlastní pokyn podniku k provedení;
- (ii) podnik nebo investiční podnik přijme pokyn od zákazníka a pošle ho jinému podniku nebo investičnímu podniku k provedení; nebo
- (iii) učiní rozhodnutí o získání nebo prodeji finančního nástroje v souladu s diskrečním pověřením poskytnutým jeho zákazníkem a zadá je jinému podniku nebo investičnímu podniku.

Pokud nedojde k předání pokynu ve smyslu článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, skutečnost, že investiční podnik je součástí řetězce, nepředstavuje rozdíl pro jeho oznamovací povinnost, s výjimkou toho, že hlášení o obchodech investičního podniku v řetězci, který předává pokyn, který není v souladu s článkem 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, odráží množství, cenu a datum a čas provedení, které mu bylo potvrzeno podnikem nebo investičním podnikem, který jeho pokyn splnil (viz 5.27.1.2). Investiční podnik nahlásí pouze svou „část“

v řetězci, a proto se nemusí dívat vpřed nebo vzad v řetězci za svou bezprostřední protistranu a zákazníka. Hlášení investičním podnikem v řetězci, kdy investiční podnik provádí činnosti podle (ii) a (iii) v odstavci uvedeném výše a kdy nejsou splněny podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, je stejné¹⁹, jako kdyby investiční podnik obchodoval přímo se systémem nebo protistranou na trhu nebo zákazníkem, aby provedl obchod (viz pododíl 5.26.2 v části III těchto obecných pokynů).

Podmínky předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 se nevztahují na podniky. Proto, pokud investiční podnik obdrží pokyny od podniku, uvede v hlášení jako kupujícího/prodávajícího podnik, který odeslal pokyn, nikoli základního zákazníka podniku. To by platilo v případě pokynů přijatých od investičního správního podniku, který není investičním podnikem. Přijímající investiční podnik uvede jako zákazníka (kupujícího/prodávajícího) investiční správní podnik, nikoli základní fondy/zákazníky.

5.3.2 Řetězec, kdy podnik obchoduje na svůj vlastní účet nebo párováním pokynů na vlastní účet

Investiční podniky, které obchodují na vlastní účet nebo párováním pokynů na vlastní účet, jednají přímo svým jménem a nejsou považovány za předávající investiční podniky vzhledem k tomu, že každý pokyn, který odešlou podniku nebo investičnímu podniku, je jejich vlastní pokyn, nikoliv předávaný pokyn obdržený od zákazníka nebo plynoucí z rozhodnutí nabýt nebo převést finanční nástroj za zákazníka na základě diskrečního pověření. Příklady viz pododíl **Error! Reference source not found.** v části III těchto obecných pokynů.

5.3.3 Předávání

Investiční podniky, které provádějí činnosti podle (ii) a (iii) v 5.3.1 výše, si mohou vybrat: buď dodrží podmínky předávání stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nebo předloží hlášení o obchodu.

Podle čl. 3 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, „Pokud investiční podnik předal pokyn v souladu s článkem 4, nemá se za to, že provedl obchod.“. Přijímající podnik vyplní stanovené informace uvedené v tabulce polí ve svém vlastním hlášení o obchodu. Přijímající podnik to provede v rámci svého běžného předkládání hlášení a nemusí se stát schváleným mechanismem pro hlášení obchodů.

Podle nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (pole 7, 16 a 25), pokud investiční podnik provádí činnost podle (ii) a (iii) v 5.3.1 a nesplňuje podmínky pro předávání podle článku 4 ve stejném nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, předkládá hlášení o obchodu a do pole Předání ukazatele pokynů vyplní „true“. Přijímající investiční podnik nahlásí přijímající investiční podnik jako svého kupujícího/prodávajícího. Pokud má zákazník předávajícího investičního podniku oznamovací povinnost, nahlásí zákazník jako kupujícího/prodávajícího předávající investiční podnik, nikoli investiční podnik přijímající (jak je uvedeno v 5.26.3.3).

Pokud investiční podnik obchoduje v obchodním systému, který není OTF jednajícím na principu párování pokynů na vlastní účet ani na vlastní účet, není daný investiční podnik předávající, protože

¹⁹ Odlišné bude pouze vyplnění pole Předání ukazatele pokynů.

nepředává pokyn investičnímu podniku, ale přímo ho sám vykoná v obchodním systému a v poli 25 vyplní „false“.

Požadavky na předávání se uplatňují na základě „všechno nebo nic“, to znamená, že pokud podnik, který odesílá pokyn, nepředává všechny informace vyžadované ke splnění podmínek předávání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, potom přijímající investiční podnik předkládá hlášení, jako by k žádnému předání nedošlo.

Pokud dojde k předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nezmění se tím uplatňování článku 14 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, proto přijímající investiční podnik zasílá všechna hlášení svému příslušnému orgánu.

K předání nedojde mezi pobočkami stejného investičního podniku, protože se nejedná o samostatné právnické osoby. Naopak, pokud k předání dojde mezi různými právnickými osobami v rámci skupiny, potom pro tyto subjekty platí stejná oznamovací povinnost, jako kdyby se jednalo o investiční podniky nebo podniky, které nejsou ve spojení.

Účelem pole 25 (Předání ukazatele pokynů) je uvést, že došlo k předání jinému investičnímu podniku v řetězci bez splnění podmínek článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Předávající investiční podnik jednající v postavení zprostředkovatele uvede v poli 25 „true“ bez ohledu na to, zda se investiční podnik pokusil o předání neúspěšně nebo zda si jen nezvolil, že předání provede.

S ohledem na výše uvedené se při vyplňování pole 25 zvažují následující případy:

(i) Pokud investiční podnik předává a splňuje všechny podmínky stanovené v článku 4, nepředkládá hlášení.

(ii) Pokud investiční podnik obchoduje přímo v obchodním systému, který není OTF jednajícím na principu párování pokynů na vlastní účet ani na vlastní účet, pole 25 (Předání ukazatele pokynů) vyplní „false“.

(iii) Pokud investiční podnik jedná na vlastní účet nebo obchoduje párováním pokynů na vlastní účet, (pole 29 = „DEAL“ / „MTCH“), v poli 25 (Předání ukazatele pokynů) vyplní „false“.

(iv) Pokud investiční podnik předává pokyny od svých zákazníků nebo umísťuje pokyny na základě diskrečního pověření zákazníka a nesplňuje podmínky v článku 4, jeho hlášení musí uvádět, že jedná „v jakémkoli jiném postavení“ (pole 29 = „AOTC“) a v poli 25 vyplní „true“.

(v) V ostatních případech, kdy investiční podnik jedná „v jakémkoli jiném postavení“ (pole 29 = „AOTC“), vyplní v poli 25 „false“.

5.4 Provádění obchodu v obchodním systému

Pro účely pole 36 se obchod považuje za provedený v obchodním systému pouze tehdy, pokud

- i) zájem dvou stran na nákupu a prodeji je soustředěn v obchodním systému buď dobrovolně, nebo na základě pevně stanovených pravidel

nebo

- ii) zájem dvou stran na nákupu a prodeji není soustředěn v obchodním systému ani dobrovolně, ani na základě pevně stanovených pravidel, ale obchod nicméně podléhá pravidlům daného obchodního systému a je proveden v souladu s těmito pravidly.

Pokud investiční podnik není přímým subjektem čelícím trhu, není tento investiční podnik považován za provádějící v obchodním systému pro účely hlášení obchodů.

5.4.1 Identifikační kód obchodů v obchodním systému (pole 3)

Podle článku 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 „organizátoři obchodních systémů přiřadí samostatný identifikační kód“ každému obchodu, který je výsledkem částečného nebo úplného provedení pokynu, který prošel jejich systémem párování. Na tento identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) se odkazuje v poli 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, v níž musí „u tržní strany obchodu provedeného v určitém obchodním systému“ investiční podniky vyplnit příslušný TVTIC generovaný organizátorem obchodního systému.

Organizátoři obchodních systémů mohou rovněž vygenerovat kódy TVTIC pro obchody spadající pod bod ii) definice „prováděný v obchodním systému“ ve výše uvedeném odstavci. Pokud je TVTIC vygenerovaný za těchto okolností a investiční podnik obdrží TVTIC od obchodního systému, může se investiční podnik rozhodnout vyplnit do pole 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 příslušný kód TVTIC vygenerovaný organizátorem obchodního systému.

5.4.2 Ohlašování pole Systém pro řetězce (pole 36)

Pokud se hlášení o obchodu použije pro obchod, který byl uskutečněn v obchodním systému, jak objasňuje odstavec 5.4 výše, se SI nebo na organizované obchodní platformě mimo Unii, vyplní se v poli 36 hlášení na tržní straně kód systému, obchodní platformy nebo SI. Ve všech ostatních hlášeních v řetězci se vyplní „XOFF“.

5.5 Identifikační kódy stran

Subjekty způsobilé pro identifikační kód právnické osoby (LEI) se identifikují pomocí LEI podle nařízení MiFIR čl. 26 odst. 6 a článku 5 a přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Mezi tyto subjekty patří zejména partnerství, společnosti, sdružení a jednotlivci jednající v postavení podnikatelů²⁰. Pobočka se identifikuje pomocí LEI jejího sídla, i když může být v některých případech považována za způsobilou pro LEI²¹.

Při provádění obchodu dbají investiční podniky na to, aby byl jejich LEI obnovován podle podmínek akreditovaných místních provozních jednotek systémů celosvětových identifikačních kódů právnických osob podle čl. 5 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, a v čl. 13 odst. 3 neexistuje žádný požadavek, který by zajistil, aby bylo obnovováno LEI pro zákazníka nebo protistranu.

²⁰ Jednotlivci jednající v postavení podnikatelů jsou za některých podmínek definovaných v čl. 4 odst. 1 bodě 1 MiFID považováni za investiční podniky. Bližší podrobnosti naleznete v prohlášení LEI ROC o způsobilosti jednotlivců jednajících v postavení podnikatelů (http://www.lei.org/publications/gls/lou_20150930-1.pdf).

²¹ Podle prohlášení LEI ROC ze dne 11. července 2016 mohou být některé pobočky považovány za způsobilé pro LEI s výhradou podmínek stanovených v prohlášení. Bližší podrobnosti naleznete v prohlášení LEI ROC (http://www.lei.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf).

Článek 6 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 uvádí, že fyzická osoba se identifikuje pomocí vnitrostátního identifikačního kódu uvedeného v příloze II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Důležité je, že čl. 26 odst. 1 nařízení MiFIR uvádí, že investiční podniky předkládají hlášení obsahující úplné a přesné údaje o obchodech. Vzhledem k tomu, že identifikační kód fyzických osob patří mezi údaje hlášení týkajícího se daného obchodu, vztahuje se požadavek hlásit úplné a přesné údaje i na identifikační kód fyzických osob. Aby mohly investiční podniky zajistit splnění tohoto požadavku, mohly by, mimo jiné, požádat fyzickou osobu, aby prokázala správnost a platnost identifikačního kódu tím, že předloží úřední dokumenty. Pokud by zákazník nepředložil žádný identifikační kód, nebyl by investiční podnik schopen dodržet oznamovací povinnost, pokud jde o tento údaj.

Ustanovení čl. 6 odst. 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 neuvádí případ fyzické osoby, která je státním příslušníkem více než jednoho státu mimo EHP. Tyto případy se řeší stejným rozřazovacím postupem použitým při řešení více národností v Evropském hospodářském prostoru.

5.5.1 Postup při generování CONCAT

Kód CONCAT se nepoužívá jako defaultní identifikační kód a nikdy se nepoužívá u těch zemí, které si podle tabulky v příloze II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 nevybraly kód CONCAT jako identifikační kód v žádné ze tří prioritních možností.

Pro účely tvorby kódu CONCAT se použije následující metoda o čtyřech krocích:

1. Získání jména a příjmení

Aby se minimalizovalo riziko rozdílu v pravopisu nebo použití zkratk, měl by investiční podnik dbát na to, aby byl pravopis celého jména osoby správný. Není dovoleno používat žádné zkrácené formy ani zkratky.

2. Odstranění titulů

Všechna označení před jménem, která označují tituly, funkce, profese nebo akademické hodnosti, se odstraní. Vztahuje se to mimo jiné i na následující seznam; tento seznam nerozlišuje malá a velká písmena:

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

3. Odstranění předložek

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

Předložky před příjmením, které nejsou uvedeny výše, nebo předpony připojené ke jménu, například McDonald, MacChrystal, O'Brian, O'Neal, se neodstraňují, ale upozorňujeme, že apostrofy se odstraní v následujícím kroku. Výše uvedený seznam nerozlišuje malá a velká písmena.

4. Transliterace apostrofů, přízvuků, spojovacích znamének, mezer a podobně

Na jméno a příjmení se použije následující transliterační tabulka, znak po znaku. Obecně řečeno, přepis ponechá anglické znaky A-Z nebo a-z nedotčené a odstraní veškerá diakritická znaménka, pomlčky, interpunkční znaménka a mezery.

Transliterační tabulka

Následující tabulka přiřazuje jeden vstupní znak jednomu výstupnímu znaku. Tato tabulka se použije na jméno a příjmení, v obou případech na prvních pět znaků, jak uvádí čl. 6 odst. 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

U všech jmen, která jsou zapsána v cyrilici, řecké nebo jiné nelatinské abecedě, a u nichž není použita žádná latinská forma, se použije anglická verze jména přepsaná pomocí konvencí pro danou abecedu.

Výstup	Vstup	Vstupní body kódu Unicode
A	Ä ä À à Á á Â â Ã ã Ä ä Ă ă Ȧ ȧ Ǽ ǽ	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 ɗ	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0
E	È è É é Ê ê Ë ë Ě ě Ę 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	Ƙ ƙ	U+0136 U+0137
L	Ł ł Ⱥ Ȼ ȼ Ƚ Ⱦ ȿ	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ñ ñ Ȧ ȧ Ǽ ǽ	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ö ö Ò ò Ó ó Ô ô Õ õ Ö ö ó Ø ø 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	Ŕ ŕ Ⱥ Ȼ	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159
S	ß ß Ś ś Š š Ş ş Š š Ş ş	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	Ŧ ŧ Ⱥ Ȼ ȼ Ƚ Ⱦ ȿ	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ü ü Ù ù Ú ú Û û Ü ü ū Ȫ ȫ Ȭ ȭ	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 ȳ Ȳ ȳ	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Ž ž Ⱥ Ȼ ȼ Ƚ Ⱦ ȿ	U+0179 U+017A U+017D U+017E U+017B U+017C
{DELETE}	Kromě a-z a A-Z se odeberou všechny ostatní znaky neuvedené výše.	

Vybrané příklady

Tyto příklady se uplatní pouze tehdy, pokud je vnitrostátním identifikačním kódem CONCAT. U většiny zemí se očekávají jiné identifikační kódy s vyšší prioritou (čl. 6 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590).

Jméno (jména)	Rodné příjmení Příjmení	Kód země + CONCAT	Poznámka
John	O'Brian	IE19800113JOHN#OBRIA	„John“ doplněno na 5 znaků. O' e připojeno ke jménu, nepřevádí se. Ostraněn apostrof.
Ludwig	Van der Rohe	HU19810214LUDWIROHE#	Odstraněna předložka „Van der“
Victor	Vandenberg	US19730322VICTOVANDE	„Van“ je připojeno, není považováno za předložku
Eli	Ødegård	NO19760315ELI##ODEGA	„Eli“ doplněno na 5 znaků. Ø převedeno na O, a å na A
Willeke	de Bruijn	LU19660416WILLEBRUIJ	Odstraněna předložka „de“
Jon Ian	Dewitt	US19650417JON##DEWIT	„Jon“ doplněno na 5 znaků. Vynecháno „Ian“, použije se pouze první jméno. Část „De“ v „Dewitt“ není předložka.
Amy-Ally	Garção de Magalhães	PT19900517AMYALGARCA	Odstraněna pomlčka ze jména. Přepsány znaky.
Giovani	dos Santos	FR19900618GIOVASANTO	Odstraněna předložka.
Günter	Voß	DE19800715GUNTEVOS##	Převedeno ü na U, a ß na S

5.5.2 Jméno (jména) a příjmení

Pro účely vyplnění všech polí, která vyžadují „Jméno (jména)“ nebo „Příjmení“ v příloze I tabulka 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, se uplatní pouze krok 1 („Získání jména a příjmení“) a krok 2 („Odebrání oslovení“) metody popsané v oddíle 5.5.1 „Postup při generování CONCAT“. Přepis je tedy nerelevantní a předložky se neodstraňují. Smí se použít každý znak používaný v některém státě EU, včetně variant diakritiky. Všechna písmena v předložkách, jménech a příjmeních se převedou na velká.

5.6 Význam pojmu „obchod“

5.6.1 Nabytí a pozbytí

Jak bylo vysvětleno v úvodu k bloku 1, příslušné orgány se o změny vlastnictví finančních nástrojů zajímají z důvodů zneužití trhu. Pohyby, které nevedou ke změně vlastnictví, nemusí být hlášeny. Jedním z příkladů je pohyb ze zákaznickova účtu provozovaného podle diskrečního pověření na účet provozovaný pouze za účelem provedení obchodu.

Výjimku představuje současné nabytí a pozbytí výslovně uvedené v čl. 2 odst. 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, kdy dojde k poobchodnímu uveřejnění obchodu. Platí to pouze pro situaci, kdy investiční podnik zasáhne svůj vlastní pokyn v knize pokynů daného obchodního systému. Příklad hlášení pro tuto situaci je uveden v oddíle 5.14.3.

5.6.2 Vyloučení z hlášení

5.6.2.1 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. a)

Pro účely čl. 2 odst. 5 písm. a) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 by se měly zvážít následující příklady:

Příklad 6

Dva investiční podniky uzavřou dohodu o zpětném odkupu (repo) ve vztahu ke státnímu dluhopisu. Jeden z investičních podniků hlásí tento obchod podle SFTR.

Na žádný z investičních podniků se nevztahuje oznamovací povinnost, protože tento obchod byl nahlášen podle SFTR.

Příklad 7

Investiční podnik, který jedná za subjekt kolektivního investování na základě diskrečního pověření, uzavře dohodu o zpětném odkupu (repo) ve vztahu ke státnímu dluhopisu. Předpokládáme, že fond má oznamovací povinnost podle SFTR a investiční podnik nemá.

Na investiční podnik se nevztahuje oznamovací povinnost podle nařízení MiFIR, protože tento obchod byl nahlášen podle SFTR.

5.6.2.2 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. b)

Z hlediska instrukcí k dodání / úhradě v rámci převodů, se na clearingovou a/nebo zúčtovací protistranu (včetně CSD) nevztahuje oznamovací povinnost podle čl. 2 odst. 5 písm. b) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, hlásit obchod musí pouze investiční podnik provádějící obchod.

Podobně v případě OTC smlouvy, u níž je prováděn clearing, nemusí být hlášena novace v různých smlouvách, u nichž je prováděn clearing.

5.6.2.3 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. d)

Příklad 8

Uschovatel/určená osoba se rozhodne, že přesune finanční nástroje z jedné depozitní banky do druhé.

Na pohyb finančních nástrojů se nevztahuje oznamovací povinnost, protože tato činnost vznikla výhradně v důsledku úschovné činnosti.

Příklad 9

Zákazník převede finanční nástroje k uschovateli / určené osobě, aby je vedl na svém svěřeneckém účtu/ účtu určené osoby.

Na tento převod se nevztahuje žádná oznamovací povinnost, protože je spojen výhradně s činností úschovy.

5.6.2.4 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. e)

Ustanovení čl. 2 odst. 5 písm. e) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 vylučuje z obchodů poobchodní dohody a novace v derivátových smlouvách, kdy jedna ze stran derivátové smlouvy je nahrazena třetí stranou. Proto předčasné ukončení smlouvy v důsledku clearingů a její následná novace, která vede k nahrazení původní smluvní strany, nepodléhá hlášení.

5.6.2.5 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. g)

Čl. 2 odst. 5 písm. g) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 vylučuje z obchodu „vytvoření nebo vyplacení podílových jednotek subjektu kolektivního investování správcem subjektu kolektivního investování“.

Pro ETF se na tento proces vytvoření nebo splacení jednotky subjektu kolektivního investování, k němuž dojde mezi oprávněným účastníkem a správcem subjektu kolektivního investování, oznamovací povinnost nevztahuje. Do tohoto procesu spadá případ, kdy oprávněný účastník poskytne podkladové finanční nástroje, které tvoří subjekt kolektivního investování, správci kolektivního investování výměnou za jednotku subjektu kolektivního investování (vytvoření). Vyloučení se rovněž vztahuje na opačný proces (splacení). Tato činnost je vyloučena, neboť hrozí minimální riziko zneužití trhu, protože se jedná o administrativní proces, při němž dochází ke směně ekonomických ekvivalentů.

Investiční podnik kupuje jednotky v subjektu kolektivního investování, který může nebo nemusí být ETF, přímo od manažera nebo správce subjektu kolektivního investování za cenu určenou podle prospektu subjektu kolektivního investování. Obchod představuje vytvoření jednotek, proto nemusí být investičním podnikem hlášen. Podobně, pokud by obchodem byl prodej investičním podnikem za stejných podmínek, představovalo by to splacení jednotek, které se nemusí hlásit.

Toto vyloučení se vztahuje pouze na proces vytvoření/splacení, který probíhá u správce subjektu kolektivního investování. Jakmile byla jednotka vytvořena, všechny nákupy a prodeje této jednotky na sekundárním trhu (včetně mimo trh) se hlásí, bez ohledu na to, zda cena nabytí nebo pozbytí byla čistou hodnotou aktiv (NAV).

Příklad 10

Investiční podnik X (oprávněný účastník) chce získat nové jednotky v subjektu kolektivního investování od správce subjektu kolektivního investování v reakci na poptávku zákazníků po jednotkách.

Pokud chce Investiční podnik X nabýt podkladové finanční nástroje, které tvoří subjekt kolektivního investování, na sekundárním trhu, aby mohl provést proces vytvoření, potom tato nabytí podkladových finančních nástrojů jsou obchodem, který se musí hlásit, pokud se jedná o podkladové finanční nástroje, které se musí hlásit podle čl. 26 odst. 2.

Pokud tedy Investiční podnik X provede směnu in specie s poskytovatelem podkladových finančních nástrojů subjektu kolektivního investování za nové jednotky, nemusí to být hlášeno jako obchod ani Investičním podnikem X, ani správcem subjektu kolektivního investování, protože jde o součást procesu vytvoření.

5.6.2.6 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. h)

Uplatnění finančního nástroje, jako je opce, krytá opční listina, konvertibilní nebo vyměnitelný dluhopis, přidělovací právo nebo upisovací právo vlastníkem finančního nástroje nezakládá oznamovací povinnost pro investiční podnik uplatňující opci ani investiční podnik, vůči němuž je finanční nástroj uplatňován²². Pokud uplatnění vede k dodání dalšího finančního nástroje, nemusí tuto skutečnost hlásit ani investiční podnik uplatňující opci, ani investiční podnik, vůči němuž je uplatňována / na něhož je převáděna.

Příklad 11

Investiční podnik X uplatňuje finanční nástroj, na uplatňování finančního nástroje se oznamovací povinnost nevztahuje.

Pokud Investiční podnik X uplatňuje finanční nástroj a místo hotovosti přijme podkladové finanční nástroje, výsledné nabytí podkladového finančního nástroje nepodléhá hlášení.

Pokud Investiční podnik X uplatňuje finanční nástroj a musí si vybrat, zda přijme hotovost nebo podkladové finanční nástroje, nemusí se to hlásit.

Příklad 12

Držitel finančního nástroje nebo konvertibilního dluhopisu uplatňuje finanční nástroj nebo konvertibilní dluhopis. V důsledku uplatnění nebo směny Investiční podnik X (strana vůči níž je uplatňováno) nabude nebo pozbyde podkladové finanční nástroje (např. v obchodním systému), aby mohl tyto nástroje dodat držitel.

Předloží se hlášení o obchodu (obchodech) ve vztahu k nabytí/pozbytí podkladových finančních nástrojů (např. nabytí v systému). Není zde však oznamovací povinnost ve vztahu k převodu těchto podkladových finančních nástrojů držiteli ani ve vztahu k uplatnění/směně finančního nástroje.

5.6.2.7 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. i)

Je zde vynětí z vyloučení v čl. 2 odst. 5 písm. i), které uvádí, že pokud k činnostem v čl. 2 odst. 5 písm. i) dojde ve vztahu k primárním veřejným nabídkám akcií, sekundárním veřejným nabídkám akcií či umístování nebo vydávání dluhopisů, musí se hlásit.

Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. i) zahrnuje ukončení finančních nástrojů v jejich lhůtě splatnosti k datu konce platnosti.

Pokud k nabytí nebo pozbytí dojde ve spojení s fúzí, převzetím, úpadkovým řízením podle nařízení Rady (ES) 1346/2000²³, štěpením akcií nebo konsolidací akcií, nemusí se hlásit. Za těchto situací se podmínky obvykle stanoví předem na valné hromadě, vyvěsí se prostřednictvím příslušného

²² K uplatnění vůči patří případy pro ETD, kdy je investiční podnik nebo jeho zákazník pověřen, aby převedl (podkladový nástroj) v důsledku procesu převodu a kdy obchod s podkladovým nástrojem provádí ústřední protistrana nebo členové clearingového systému ústřední protistrany v rámci provedení pokynu k uplatnění další strany.

²³ NAŘÍZENÍ RADY (ES) č. 1346/2000 ze dne 29. května 2000 o úpadkovém řízení

informačního oznámení a na investory se tato dohoda vztahuje bez toho, aniž by investoři činili další rozhodnutí.

Vydávání akciových dividend nemusí být hlášeno s výhradou vynětí uvedeného výše, protože zahrnuje vytvoření finančních nástrojů v důsledku předem stanovených smluvních podmínek, kdy investor v době vytvoření nástrojů neprovádí žádné investiční rozhodnutí.

Rovněž automatické zvyšování nebo snižování pomyslné hodnoty plynoucí z amortizačních harmonogramů nemusí být hlášeno, protože podmínky již byly stanoveny v okamžiku počáteční smlouvy a v době snižování/zvyšování pomyslné hodnoty nedochází k žádnému rozhodnutí.

Události, kdy investor učiní rozhodnutí v okamžiku vytvoření, ukončení platnosti nebo splacení, však musí být hlášeny. Tyto události zahrnují případ, kdy si zákazník v nabídce na převzetí volí, zda obdrží hotovost nebo nástroje, nebo když má emitent možnost volit, zda dodá hotovost nebo finanční nástroje.

Příklad 13

Investiční podnik X drží dluhopisy ve společnosti, které mají splatnost 5 let. Podle podmínek vydání má společnost právo umořit část finančních nástrojů před datem splatnosti. Ve 3. roce společnost umoří část nominální hodnoty emise dluhopisů.

Ve vztahu k umoření dluhopisů neexistuje žádná oznamovací povinnost. Důvodem je to, že jde o důsledek předem stanovených smluvních podmínek, které jsou mimo kontrolu investora (Investičního podniku X).

5.6.2.8 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. l)

Ustanovení čl. 2 odst. 5 písm. l) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 vylučuje z obchodů „nabytí na základě plánu reinvestování dividend“.

Plán reinvestování dividend (DRIP) je varianta akciové investice, kdy namísto přímého přijetí dividend jako hotovosti se investor předem rozhodne, že přímo reinvestuje své dividendy do podkladových akcií.

Ve vztahu k výše uvedenému popisu se nabytí akcií netýká žádná oznamovací povinnost.

5.6.2.9 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. m)

Toto vyloučení se netýká hlášení blokových pokynů (sdružených nabytí a pozbytí na trhu na účet zákazníků v oblasti působnosti investičních spořicíh plánů a plánů čerpání investic), protože ačkoli se nabytí a pozbytí řídí plánem, některá rozhodnutí se přijímají v okamžiku nabytí nebo pozbytí, a proto nejsou splněny všechny podmínky stanovené pro vyloučení.

Příklad 14

Společnost nabízí svým zaměstnancům možnost nabýt akcie, podle plánu, kdy množství nabytých akcií činí 3 % ročního platu zaměstnance, k nákupu dojde v poslední den každého čtvrtletí za tržní cenu se slevou a pokud zaměstnanec oznámí své rozhodnutí o nákupu nejpozději ke konci předchozího měsíce.

Společnost najme Investiční podnik X, aby jako zastupující banka alokoval akcie zaměstnancům a aby přijímal platby jménem společnosti.

Zaměstnanec se rozhodne, že v březnu prostřednictvím plánu nakoupí akcie za 350 EUR (tržní cena). Zaměstnanec se rovněž bude podílet v září částkou 375 EUR a v prosinci 400 EUR.

Investiční podnik X nemá oznamovací povinnost za březen, září ani prosinec, protože žádné z těchto nabytí nepřekračuje 500 EUR za měsíc a nejde o jednorázový obchod v rámci plánu, ačkoli překračuje celkem 1000 EUR.

5.6.2.10 Vyloučení podle čl. 2 odst. 5 písm. n)

Příklad 15

Společnost učiní nabídku na odkup svých dluhopisů od investorů s prémie. Podmínky pro nabídku již byly zveřejněny v informačním dokumentu nebo prospektu. Společnost najme Investiční podnik X, aby jednal jako správce.

Investiční podnik X ani investoři nemají žádnou oznamovací povinnost, protože podmínky byly předem zveřejněny a investoři měli pouze možnost přijmout nebo odmítnout nabídku na odkup.

5.7 Mechanismus hlášení

Popis toho, jak příslušné orgány zpracovávají hlášení přijatá od podávajících subjektů, naleznete v příloze I těchto obecných pokynů.

5.7.1 Pole, které nelze vyplnit, a vyplňování polí referenčními údaji o nástroji

Pokud tabulka polí uvádí, že pole nelze vyplnit za okolností definovaných v popisu pole nebo ve validační tabulce, která je k dispozici na https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf, dané pole se nevyplní a hlášení o obchodu se zamítne, pokud nebude v souladu s validacemi uvedenými v tabulce na internetových stránkách ESMA. Pokud například podnik v hlášení uvede, že k provedení došlo pomocí algoritmu, nevyplňuje se pole 60 (Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení).

Situace s vyplňováním referenčních údajů se mírně liší. Tabulka 2 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 uvádí, že pole 42 až 56 (pole referenčních údajů o nástroji) jsou nerelevantní, pokud se obchody provádějí v obchodním systému nebo pokud investiční podnik jedná jako SI nebo pokud referenční údaje pro ISIN hlášené investičním podnikem v poli 41 jsou v seznamu referenčních údajů vedeném ESMA. Pokud je splněna jedna z těchto podmínek, investiční podniky nemusí tato pole vyplňovat. ESMA rovněž soudí, že jakýkoli jiný obchod provedený v den obchodování s nástrojem, u kterého investiční podnik sám provedl nejméně jeden obchod v daný obchodní den v obchodním systému nebo pokud investiční podnik jedná jako SI, splňuje podmínky stanovené v tabulce 2, a proto pole referenčních údajů o nástroji nejsou u takového obchodu vyžadována.

Příklad 16

Investiční podnik X koupí nástroj Y v obchodním systému a později v ten den prodá nástroj Y mimoburzově jinému investičnímu podniku nebo podniku. Nástroj Y není v seznamu referenčních

údajů poskytovaném ESMA²⁴. K nákupu došlo v obchodním systému, a proto se pole referenčních údajů o nástroji nemusí v hlášení o nákupu vyplňovat. Prodej přímo nesplňuje podmínky, jelikož k němu nedochází v obchodním systému, ale protože ke koupi došlo v tentýž den v obchodním systému, nemusí se pro hlášení o prodeji vyplňovat ani pole referenčních údajů o nástroji.

Pokud nejsou tyto podmínky splněny, investiční podniky vyplní všechna pole 42 až 56, které jsou pro daný nástroj relevantní.

Příslušné orgány však nezamítnou hlášení o obchodu, pokud investiční podnik vyplní pole referenčních údajů o nástroji v případě, že se s nástrojem obchoduje v obchodním systému nebo že je nástroj na seznamu ESMA.

5.7.2 Předkládání hlášení o obchodech

Podle čl. 26 odst. 7 nařízení MIFIR se investiční podnik může spolehnout, že obchodní systém nahlásí informace o tržní straně obchodu provedeného v obchodním systému. Obchodní systémy mohou rovněž nabídnout službu, že nahlásí informace za stranu zákazníka u obchodu, který se neprovede v jejich systémech, pokud se zaregistrují jako schválený mechanismus pro hlášení obchodů.

Pokud obchodní systém předkládá hlášení jménem investičního podniku, měl by podat informace příslušnému orgánu, kterému je musí předložit investiční podnik, bez ohledu na to, kde obchodní systém sídlí.

Pokud obchodní systém předkládá hlášení u obchodů prováděných podnikem podle čl. 26 odst. 5 nařízení MIFIR, podává informace svému domovskému příslušnému orgánu.

5.7.2.1 Lhůta pro předkládání hlášení o obchodech

5.7.2.1.1 Časové rozvržení pro hlášení

Obchody musí být nahlášeny příslušnému orgánu investičních podniků²⁵ nejpozději ve 23:59:59 místního času domovského příslušného orgánu v pracovní den následující po dni obchodu (tj. obchody provedené v den T se hlásí nejpozději ve 23:59:59 dne T+1). Investiční podniky mohou hlásit informace o svých obchodech provedených v den T také ve stejný den (tj. v den T) bez ohledu na to, zda hlášení vytvářejí přímo investiční podniky nebo schválený mechanismus pro hlášení obchodů jednající jejich jménem nebo obchodní systém, jehož prostřednictvím byly obchody provedeny. To znamená, že podniky musí předložit informace obchodnímu systému nebo schválenému mechanismu pro hlášení obchodů včas, aby obchodní systém nebo schválený mechanismus pro hlášení obchodů mohl předložit hlášení příslušnému orgánu do termínu T+1.

5.7.2.1.2 Pracovní den

Pracovními dny jsou všechny dny v týdnu s výjimkou soboty a neděle a s výjimkou všech úředních státních svátků v rámci členského státu vnitrostátního příslušného orgánu, kterému se předkládá hlášení o obchodu.

²⁴ V nepravděpodobném případě, kdy obchodní systém neodešle referenční údaje o nástroji.

²⁵ Nebo v případě obchodních systémů předkládajících hlášení na účet členů, kteří nejsou investičními podniky, domovskému příslušnému orgánu obchodního systému.

Část II – Bloky

5.8 Blok 1: Identifikace kupujícího/prodávajícího

Příslušné orgány se kvůli možnosti zneužití trhu zajímají o základního zákazníka, nikoli o vlastníka právního nároku. Proto, pokud dojde k pohybu, který vede u zákazníka ke změně vlastnictví, hlásí se jako kupující/prodávající zákazník, nikoli uschovatel / určená osoba, který může držet právní nárok. Nicméně s výjimkou předání, kdy jsou splněny podmínky pro předání podle článku 4, čímž se zabývá oddíl 5.26.3, hlásí investiční podniky svého přímého zákazníka. Od investičního podniku se neočekává, že bude zkoumat svého zákazníka nebo protistranu ve snaze zjistit, kdo je konečným zákazníkem. Pokud například nemá investiční podnik údaje o základním zákazníkovi (základních zákaznících), nemusí zkoumat svěřenský fond až k základnímu zákazníkovi (základním zákazníkům), ale pouze nahlásí svěřenský fond (který se identifikuje pomocí jeho LEI) jako kupujícího/prodávajícího. Pokud však investiční podnik zná zákazníka a zřídí dohodu o svěřenectví jako u osobních penzí s vlastními investicemi, hlásí se jako kupující/prodávající zákazník, nikoli svěřenský fond.

Upozorňujeme, že obchodní případy 5.8.1-5.10.1 uvedené níže ukazují identifikační a další údaje kupujících, ale totéž platí i pro prodávající.

5.8.1 Kupující/prodávající, který je způsobilý k LEI

Toto platí za následujících okolností:

Kupující/prodávající je podnik nebo investiční podnik, který je tržní protistranou;

Kupující/prodávající je ústřední protistranou (platí, pokud obchod probíhá v obchodním systému v anonymní knize pokynů s ústřední protistranou);

Kupující/prodávající je investiční podnik jednající jako systematický internalizátor;

Kupující/prodávající je zákazník, který je způsobilý k LEI (viz oddíl 5.5 o identifikačních kódech pro strany v části I).

Příklad 17

Investiční podnik X provede obchod za Zákazníka A, který kupuje finanční nástroj.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<Tx> <New>
9	Kupující – jméno (jména)		... <Buyr>
10	Kupující – příjmení		<AcctOwnr>
11	Kupující – datum narození		<Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>

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

5.8.2 Kupující/prodávající je fyzická osoba

5.8.2.1 Kupující/prodávající je občan členského státu Evropského hospodářského prostoru (jedno občanství)

Podle článku 6 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 se fyzická osoba identifikuje v hlášení pomocí zřetězení kódu země podle ISO 3166-1 alfa 2 státního občanství osoby, po němž následuje identifikační kód uvedený v příloze II tohoto nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 podle státního občanství této osoby. Dále podle článku 7 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, pokud je zákazníkem fyzická osoba, mělo by hlášení o obchodu obsahovat celé jméno a datum narození zákazníka.

Příklad 18

Investiční podnik X provede obchod za Zákazníka 2, který kupuje finanční nástroj.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} pro Jose Luise Rodrigueze de la Torre	<Tx> <New> ...
9	Kupující – jméno (jména)	„JOSE,LUIS“	<Buyr> <AcctOwnr>
10	Kupující – příjmení	„RODRIGUEZ,DE LA TORRE“	<Id> <Prsn>
11	Kupující – datum narození	„1976-02-27“	<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>

Použitý identifikační kód je určen státním občanstvím osoby, nikoli tím, kde žije, ani umístěním Investičního podniku X.

Protože investor je španělský státní příslušník, identifikační kód je podle přílohy II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 daňové identifikační číslo (Código de identificación fiscal). Systémové jméno „NIDN“ označuje použití vnitrostátního identifikačního kódu zákazníka. Hodnota „CCPT“ by označovala použití čísla pasu, zatímco zřetězení státního občanství, data narození a zkratky jména se označuje systémovým jménem „CONCAT“. Dva příklady za tímto oddílem ilustrují všechna tři použití.

5.8.2.2 Kupující/prodávající není občan členského státu Evropského hospodářského prostoru (jedno občanství)

Příklad 19

Investiční podnik X prodává na vlastní účet finanční nástroj zákazníkovi. Zákazníkem je americký státní příslušník Paul O'Connor, který žije v Portugalsku. Jeho datum narození je 4. března 1941.

Jak stanoví příloha II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, použije se k identifikaci Paula O'Connora v hlášení o obchodu číslo amerického cestovního pasu, protože je pro účely hlášení obchodů pro použité identifikační kódy určující státní příslušnost, nikoli místo pobytu osoby.

Číslo amerického cestovního pasu Paula O'Connora je 123456789ZZ.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Paula O'Connora}	<pre> <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> </pre>
9	Kupující – jméno (jména)	,PAUL'	
10	Kupující – příjmení	,O'CONNOR'	
11	Kupující – datum narození	,1941-03-04'	

Pokud Paul O'Connor nemá číslo amerického cestovního pasu, potom se v poli 7 vyplní zřetězené číslo vytvořené jako US19410304PAUL#OCONN.

5.8.2.3 Kupující/proávající má dvojí státní občanství (dva členské státy Evropského hospodářského prostoru)

Příklad 20

Investiční podnik X provádí obchod za zákazníka.

Zákaznice Anne-Marie Berg, která kupuje finanční nástroj, má švédské a francouzské státní občanství a její datum narození je 3. prosince 1963.

V souladu s požadavky čl. 6 odst. 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 je kód ISO 3166 alfa pro Francii (FR) v abecedě před Švédskem (SE). Proto se jako první priorita použije číslo pro Francii, což je kód CONCAT (příloha II nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590), nikoli švédské osobní identifikační číslo. Číslo CONCAT musí být FR19631203ANNEMBERG#.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Anne-Marie Berg}	<TxRpt> <Tx>
9	Kupující – jméno (jména)	„ANNE-MARIE“	<New>
10	Kupující – příjmení	„BERG“	...
11	Kupující – datum narození	„1963-12-03“	<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>

5.8.2.4 Kupující/proávající má dvojí státní občanství (členského státu Evropského hospodářského prostoru a jiné než členského státu Evropského hospodářského prostoru)

Příklad 21

Investiční podnik X provede obchod za zákazníka Davida Štefana, který kupuje finanční nástroj. Zákazník má australské a rumunské státní občanství a jeho datum narození je 8. května 1952.

Podle čl. 6 odst. 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 má státní občanství členského státu Evropského hospodářského prostoru přednost, a proto se použije rumunské vnitrostátní identifikační číslo (Cod Numeric Personal).

Rumunské vnitrostátní identifikační číslo pro Davida Ștefana je 1234567890123.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Davida Ștefana}	<Tx> <New>
9	Kupující – jméno (jména)	,DAVID“	... <Buyr>
10	Kupující – příjmení	,ȘTEFAN‘	<AcctOwnr>
11	Kupující – datum narození	,1952-05-08‘	<Id> <Prsn> <FrstNm>DAVID</FrstNm> <Nm>ȘTEFAN</Nm> <BirthDt>1952-05-08</BirthDt> <Othr> <Id>RO1234567890123</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>

Pokud v příkladu uvedeném výše nemá osoba rumunské vnitrostátní identifikační číslo, použije se číslo rumunského pasu. Pokud osoba nemá pas, použije se kód CONCAT. Kód CONCAT by měl být RO19520508DAVIDSTEFA.

5.9 Blok 2: Subjekt s rozhodovací pravomocí za kupujícího/prodávajícího

Následující obchodní případy uvádějí identifikaci subjektu s rozhodovací pravomocí za kupujícího, ale stejný přístup platí pro osobu s rozhodovací pravomocí za prodávajícího.

Jak uvádí tabulka 2 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, pole pro osobu s rozhodovací pravomocí za kupujícího (pole 12–15) jsou relevantní pouze v případě, kdy je zákazník kupujícím a investiční rozhodnutí se činí na základě oprávnění k zastupování. Oprávnění k zastupování odkazuje na třetí stranu nebo třetí strany, které nejsou zaměstnanci zákazníka a kterým bylo udělena pravomoc přijímat investiční rozhodnutí na účet zákazníka. Třetí strana (strany) může být nesouvisející s provádějícím investičním podnikem, nebo může jít o provádějící investiční podnik samotný. Oprávnění k zastupování může udělit zákazník, kterým je fyzická osoba nebo právnická osoba a osoby, které získaly oprávnění jednat za zákazníka, mohou být rovněž fyzickými osobami nebo právnickými osobami.

Pokud je třetí stranou investiční podnik, vyplní se do pole 12 identita investičního podniku, nikoli jednotlivá osoba s rozhodovací pravomocí v daném investičním podniku (jednotlivé osoby s rozhodovací pravomocí se týká pole 57).

K tomuto dochází za následujících okolností:

pokud osoba s oprávněním k zastupování pověří investiční podnik (patří sem dohoda o plné moci); nebo na základě diskrečního pověření uděleného kupujícím provádějícím investičnímu podniku.

Pokud kupující/proávající udělil oprávnění k zastupování více než jedné osobě, vyplní se v poli pro subjekt s rozhodovací pravomocí pouze osoba (osoby), která pověřila investiční podnik.

Za všech ostatních okolností se předpokládá, že subjektem s rozhodovací pravomocí je kupující, a v těchto případech se pole související se subjektem s rozhodovací pravomocí (pole 12–15) nevyplňují. Patří sem rovněž případ, kdy existuje dohoda o plné moci, ale rozhodnutí u konkrétního obchodu učinil kupující, nikoli osoba (osoby) s plnou mocí.

Doporučení a rady netvoří investiční rozhodnutí, a proto pokud dojde pouze k doporučení nebo radě, pole pro subjekt s rozhodující pravomocí se nevyplní.

V konkrétních případech fondů a společností pro správu fondů se společnost pro správu fondů označí investičním podnikem provádějícím jeho pokyn jako kupující/proávající a pole pro subjekt s rozhodovací pravomocí se nevyplní, pokud nedojde k žádnému předání, které splňuje podmínky článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (viz oddíl 5.27.1).

5.9.1 Subjektem s rozhodovací pravomocí je kupující/proávající

Příklad 22

Investiční podnik X provede obchod za Zákazníka A, který kupuje finanční nástroj. Rozhodnutí koupit učiní Zákazník A.

Jak hlásí Investiční podnik X údaje o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<Tx> <New>
9	Kupující – jméno (jména)		...
10	Kupující – příjmení		<Buyr>
11	Kupující – datum narození		<AcctOwnr>
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		<Id>
13	Subjekt rozhodující o nákupu – jméno (jména)		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI>
14	Subjekt rozhodující o nákupu – příjmení		</Id>
			</AcctOwnr>
			</Buyr>
			...
			</New>
			</Tx>

15	Subjekt rozhodující o nákupu – datum narození		
----	---	--	--

Protože investiční rozhodnutí činí kupující, zůstanou pole pro subjekt s rozhodovací pravomocí prázdná.

5.9.2 Subjektem s rozhodovací pravomocí je třetí strana s oprávněním k zastupování kupujícího/prodávajícího

5.9.2.1 Subjektem s rozhodovací pravomocí je strana s plnou mocí

Příklad 23

Investiční podnik X provede obchod za zákazníka Seana Murphyho, který kupuje finanční nástroj.

Sean Murphy je irský státní příslušník a jeho datum narození je 27. února 1976. Pan Murphy poskytl plnou moc ke svému účtu svému právníku Thomasi MacCormackovi, který je irským státním příslušníkem, narozeným 12. prosince 1951. Pokyn k nákupu zadal pan MacCormack.

Jak hlásí Investiční podnik X údaje o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Seana Murphyho	<Tx> <New>
9	Kupující – jméno (jména)	,SEAN'	...
10	Kupující – příjmení	,MURPHY'	<Buyr>
11	Kupující – datum narození	,1976-02-27'	<AcctOwnr> <Id>
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí	{NATIONAL_ID} Thomase MacCormacka	<Prsn> <FrstNm>SEAN</FrstNm> <Nm>MURPY</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt>
13	Subjekt rozhodující o nákupu – jméno (jména)	,THOMAS'	<Othr> <Id>IE19760227SEAN#MURPH</Id> <SchmeNm>
14	Subjekt rozhodující o nákupu – příjmení	,MACCORMACK'	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm>
15	Subjekt rozhodující o nákupu – datum narození	,1951-12-12'	</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>

			<pre> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Protože Sean Murphy a Thomas MacCormack jsou oba irští státní příslušníci, použije se zřetězený kód, protože to je pro Irsko první prioritou. Tyto kódy budou IE19760227SEAN#MURPH a IE19511212THOMAMACCO.

5.9.2.2 Subjektem s rozhodovací pravomocí je investiční podnik, který jedná za kupujícího/prodávajícího na základě diskrečního pověření

Příklad 24

Investiční podnik X provádí obchod za zákazníka na základě diskrečního pověření. Proto Investiční podnik X činí investiční rozhodnutí na účet zákazníka. Zákazník Pepe Torres Blanco je mexický státní příslušník s číslem cestovního pasu MMM23654Z a narodil se 20. května 1968.

Jak hlásí Investiční podnik X údaje o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Pepe Torrese Blanca	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
9	Kupující – jméno (jména)	‚PEPE‘	<pre> <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>
10	Kupující – příjmení	‚TORRES‘, ‚BLANCO‘	
11	Kupující – datum narození	‚1968-05-20‘	
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí	{LEI} Investičního podniku X	
13	Subjekt rozhodující o nákupu – jméno (jména)		
14	Subjekt rozhodující o nákupu – příjmení		
15	Subjekt rozhodující o nákupu – datum narození		

5.10 Blok 3 (kombinace 1 a 2): Konkrétní scénáře pro kupujícího/prodávajícího a subjekt s rozhodovací pravomocí

Podobně jako u předchozích bloků je u obchodního případu uvedeného níže ukázána identifikace a další údaje kupujících, ale totéž platí i pro prodávající.

5.10.1 Kupující/prodávající mají společný účet

Příklad 25

Investiční podnik X provádí obchod za společný účet, který vlastní manželé Pierre DuPont a Marie DuPont. Pierre DuPont má francouzské státní občanství a narodil se 27. února 1976. Jeho manželka Marie má polské státní občanství, datum narození 17. ledna 1977 a vnitrostátní identifikační číslo (PESEL) 1234567890. Investiční rozhodnutí činí zástupce tohoto společného účtu Charles Owen, jehož datum narození je 11. října 1968. Pan Owen je jihoafrický státní příslušník (číslo cestovního pasu 1111222233334).

Společný účet kupuje finanční nástroj.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o kupujícím?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Pierra DuPonta {NATIONAL_ID} Marie DuPont	<Tx> <New> ... <Buyr>
9	Kupující – jméno (jména)	,PIERRE' ,MARIE'	<AcctOwnr> <Id>
10	Kupující – příjmení	,DUPONT' ,DUPONT'	<Prsn> <FrstNm>PIERRE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm>
11	Kupující – datum narození	,1976-02-27' ,1977-01-17'	<BirthDt>1976-02-27</BirthDt>
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí	{NATIONAL_ID} Charlese Owena	<Othr> <Id>FR19760227PIERRDUPON</Id> <SchmeNm>
13	Subjekt rozhodující o nákupu – jméno (jména)	,CHARLES'	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr>
14	Subjekt rozhodující o nákupu – příjmení	,OWEN'	</Prsn> </Id>
15	Subjekt rozhodující o nákupu – datum narození	,1968-10-11'	</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>

			<pre> </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>
--	--	--	---

Pole 7–11 se musí opakovat pro každého kupujícího.

Subjekt s rozhodovací pravomocí jedná za společný účet, nikoli za každého jednotlivce, a proto se vyplní pouze jednou.

5.10.2 Prodávající zesnul

U obchodů plynoucích ze soudně potvrzené závěti zesnulých zákazníků nebo z dědictví, se zesnulá osoba hlásí jako prodávající a tato zesnulá osoba je považována za subjekt s rozhodovací pravomocí, a proto se pole pro subjekt s rozhodovací pravomocí nevyplní. Pokud strana dědí finanční nástroje, nahlásí se jako kupující a strana, která dědí, se považuje za subjekt s rozhodovací pravomocí a pole pro subjekt s rozhodovací pravomocí se nevyplní.

5.11 Blok 4: Pole Investiční rozhodnutí v rámci podniku

5.11.1 Pole Investiční rozhodnutí v rámci podniku

Jak stanoví čl. 8 odst. 1 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, toto pole se vyplní vždy, pokud investiční podnik obchoduje na vlastní účet, protože se tím jeho portfolio stává předmětem rizika, a proto se má za to, že činí investiční rozhodnutí. Jediná výjimka zde je v rámci kontextu předání, kdy investiční podnik hlásí obchody jako přijímající investiční podnik a obchoduje na vlastní účet, přičemž v souladu s polem 57 vyplní hlášení na straně zákazníka informacemi poskytnutými předávajícím investičním podnikem (viz oddíly 5.26.3.1, 5.26.4.1, 5.26.4.2 a 5.27.2).

Dále podle čl. 8 odst. 1 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 se toto pole rovněž vyplní, pokud investiční podnik činí investiční rozhodnutí za zákazníka jednajícího na základě diskrečního pověření – (viz oddíl 5.27.1).

Příklad 26

Investiční podnik X kupuje finanční nástroj.

Obchodník 1 je osoba v rámci investičního podniku primárně odpovědná za investiční rozhodnutí.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Investiční rozhodnutí v rámci podniku?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	<pre> <Tx> <New> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Upozorňujeme, že na rozdíl od údajů o kupujícím nejsou u konkrétního jednotlivce odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci investičního podniku požadovány žádné údaje. Jedinou požadovanou informací je vnitrostátní identifikační kód daného jednotlivce.

Pokud za investiční rozhodnutí primárně odpovídá algoritmus v rámci investičního podniku, vyplní se v poli 57 kód algoritmu.

5.11.2 Investiční rozhodnutí učiněné mimo podnik (zákazník učiní investiční rozhodnutí a investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet nebo jedná v „jakémkoli jiném postavení“)

Příklad 27

Investiční podnik X obchoduje párováním pokynů na vlastní účet nebo jedná v „jakémkoli jiném postavení“ a kupuje finanční nástroj pouze pro provedení nebo pro zákazníka v poradenském postavení.

Má se za to, že investiční rozhodnutí činí zákazník bez ohledu na to, zda finanční nástroj zákazníkovi doporučil Investiční podnik X, protože v konečném důsledku učinil investiční rozhodnutí zákazník.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Investiční rozhodnutí v rámci podniku?

Protože Investiční podnik X jedná v „jakémkoli jiném postavení“ nebo obchoduje párováním pokynů na vlastní účet, nevyplní se ani pole 57, ani pole 12.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
----	------	---------	----------------

57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		<pre> <Tx> <New> ... <FinInstrm> ... </FinInstrm> <ExctgPrsn> ... </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre> <p><i>Pokud není pole vyplněno, příslušný XML prvek (tj. <InvstmtDcsnPrsn>) nemůže být ve zprávě přítomen</i></p>
----	---------------------------------------	--	--

Pokud místo toho Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet, i když může obchod iniciovat zákazník, má se za to, že Investiční podnik X učinil rozhodnutí o investici, a proto se pole 57 vyplní, zatímco pole 12 zůstane prázdné.

5.12 Blok 5: Pole Provedení obchodu v rámci podniku

Pole 59 se vyplní v každém hlášení o obchodu. V případech, kdy rozhodnutí o provedení učinil zákazník (např. zákazník nařídí podrobnosti obchodu včetně místa provedení) nebo jiná osoba mimo investiční podnik (např. zaměstnanec společnosti v rámci stejné skupiny), investiční podniky použijí v tomto poli defaultní hodnotu „NORE“.

Příklad 28

Investiční podnik X kupuje finanční nástroj na účet zákazníka, kdy zákazník výslovně nařídil podrobnosti obchodu.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Provedení obchodu v rámci podniku?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
59	Provedení obchodu v rámci podniku	„NORE“	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <CInt>NORE</CInt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Pokud je pole vyplněno kódem jiným než „NORE“, je tímto kódem – jak stanoví článek 9 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 – buď identifikační kód osoby v rámci investičního podniku, nebo identifikační kód algoritmu v rámci investičního podniku, podle toho, který z nich je primárně odpovědný za provádění. To má za povinnost stanovit investiční podnik v souladu se svým modelem řízení.

5.12.1 Primární odpovědnost za provedení má osoba

Pokud je za provedení primárně odpovědná osoba, vyplní se v poli 59 vnitrostátní identifikační kód této osoby.

5.12.2 Primární odpovědnost za provedení má algoritmus

Příklad 29

Pokud se k provedení použije algoritmus, vyplní se v poli 59 algoritmus podle tabulky 2 v příloze I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Investiční podnik X kupuje finanční nástroj a algoritmus Investičního podniku X (kód: 4567EFZ) odpovídá za provedení této transakce.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Provedení obchodu v rámci podniku?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{Kód algoritmu}	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Algo>4567EFZ</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Pojmem „algoritmus“ se rozumí libovolný systém, který automaticky provádí obchody bez lidského zásahu. Rovněž v tomto případě se vyplní identifikační kód pro automatizovaný systém.

5.13 Blok 6: Datum a čas obchodování

Datum a čas obchodování v hlášení je okamžikem, kdy dojde k obchodu a kdy se strany zavážou k obchodu, nikoli datum a čas následného potvrzení.

Pokud investiční podnik zasílá pokyn podniku mimo Evropský hospodářský prostor, který provede pokyn, vynaloží investiční podnik maximální úsilí, aby získal co nejpřesnější datum a čas.

V poli 28 Datum a čas obchodování se hodnoty nezaokrouhlují a úroveň podrobnosti musí být v souladu s požadavky stanovenými v poli 28 tabulky 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Podrobnější informace o požadavcích na podrobnost v hlášeních o obchodu viz oddíl 7.2 o podrobnosti časového razítka.

5.14 Blok 7: Systém

Příklady v tomto bloku se věnují vyplnění pole Systém a dalších příslušných polí pro přímý obchod na trhu. Je třeba poznamenat, že, jak je vysvětleno v oddílu 5.4.2 k „Ohlašování pole Systém pro řetězce“,

přímé provedení v obchodním systému²⁶ na obchodní platformě nebo SI se označuje jako v systému. Příklady vyplnění pole Systém v jiných situacích viz 5.22 až 5.24 a 5.26–5.27 (scénáře související s více provedeními, seskupováním pokynů, OTF obchodujícím párováním pokynů na vlastní účet a prováděním prostřednictvím řetězce investičních podniků, předáváním a investičním podnikem jednajícím na základě diskrečního pověření).

Informace o tom, jak hlásit obchody s konkrétními finančními nástroji, jsou uvedeny v části IV.

5.14.1 Provedení obchodu v obchodním systému v anonymní knize pokynů

Příklad 30

Investiční podnik X prodává finanční nástroj v obchodním systému. Obchod byl proveden dne 5. května 2018 v 09:10:33.124373. Obchodní systém vygeneruje identifikační kód obchodu v obchodním systému (TVTIC) (ABCDEFG123456).

a) Obchodní systém M (který používá ústřední protistranu).

b) Obchodní systém B nepoužívá ústřední protistranu a totožnost nabývajících/pozbývajících strany nebyla v době provedení zveřejněna. Jeho segment MIC je „XABC“.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Systém a souvisejících polích?

Č.	Pole	Hodnoty scénáře a)	Hodnoty scénáře b)
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	„ABCDEFG123456“	„ABCDEFG123456“
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	Segment {MIC} obchodního systému B
28	Datum a čas obchodování	„2018-05-05T09:10:33.124Z“	„2018-05-05T09:10:33.124Z“
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} obchodního systému B

Znázornění XML:

Hlášení pro scénář a)	Hlášení pro scénář b)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </New> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <MIC>XABC</MIC> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </New> </pre>

²⁶ Včetně případů, kdy se obchody dohodnuté mimo obchodní systém uvádějí podle pravidel daného obchodního systému.

<pre> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglId>ABCDEF123456</TradPlc MtchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XABC</TradVn> <TradPlcMtchglId>ABCDEF123456</TradPlcM tchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

5.14.2 Provádění obchodu na obchodní platformě mimo Unii v neanonymní knize pokynů

Příklad 31

Investiční podnik X prodává finanční nástroj, který musí být nahlášen, na organizované obchodní platformě mimo Unii (MIC: XAAA) výběrem pokynu k nákupu Investičního podniku Y. Obchod byl proveden dne 10. září 2018 v 13:15:45.122469.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Systém a souvisejících polích?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému		<pre> <Tx> <New> ... </pre>
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </pre>
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-10T13:15:45Z'	<pre> <TradDt>2018-09-10T13:15:45Z</TradDt> ... </pre>
36	Systém	Segment {MIC} obchodní platformy	<pre> <TradVn>XAAA</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Identifikační kód obchodu v obchodním systému v tomto případě neplatí, protože obchod není proveden v obchodním systému.

Investiční podnik X zná tržní protistranu (Investiční podnik Y), a proto je tržní protistrana uvedena v hlášení o obchodu, v tomto případě jako kupující.

Protože k obchodu nedochází v obchodním systému, musí být podrobnost uváděná u času v sekundách nebo lepší.

5.14.3 Provedení obchodu v obchodním systému výběrem svého vlastního pokynu v anonymní knize pokynů

Jak bylo uvedeno v oddílu „Význam pojmu „obchod““ 5.6 v části I, toto je situace, pro kterou je určeno ustanovení čl. 2 odst. 4.

Příklad 32

Investiční podnik X jednající na vlastní účet vybere svůj vlastní pokyn v Obchodním systému M, který vygeneruje identifikační kód obchodu v obchodním systému (TVTIC) (ABCDEFGH123456) pro tento obchod provedený dne 15. července 2018 v 11:37:22.867415.

Jak hlásí Investiční podnik X v poli Systém a souvisejících polích?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	„ABCDEFGH123456“	„ABCDEFGH123456“
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M
28	Datum a čas obchodování	„2018-07-15T11:37:22.867Z“	„2018-07-15T11:37:22.867Z“
29	Postavení	„DEAL“	„DEAL“
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...</pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...</pre>

<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <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> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <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 Systematický internalizátor provádějící obchod

Příklad 33

Investiční podnik Y chce prodat akcie. Investiční podnik X, jednající jako systematický internalizátor (SI), kupuje akcie od Investičního podniku Y. Obchod byl proveden dne 15. července 2018 v 11:37:22.Z.

Segment MÍC systematického internalizátora je ‚SMIC‘.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
28	Datum a čas obchodování	‚2018-07-15T11:37:22.Z‘	‚2018-07-15T11:37:22.Z‘
29	Postavení	‚DEAL‘	‚DEAL‘
36	Systém	Segment {MIC} SI (Investiční podnik X)	Segment {MIC} SI (Investiční podnik X)

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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>ABCDEFGHIJKLMNQRST</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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 Blok 8: Příznak prodeje na krátko

Následující obchodní případy se týkají situací, kdy investiční podnik prodává na krátko²⁷ akcie nebo státní dluhopisy, které musí být hlášeny v rámci působnosti článků 12, 13 a 17 nařízení (EU) č. 236/2012 buď na svůj vlastní účet, nebo na účet zákazníka. Investiční podnik požádá zákazníka, aby zveřejnil, zda prodává na krátko.

Pokud zákazník neinformuje investiční podnik o prodeji na krátko, do pole 62 se vyplní „UNDI“.

Příznak prodeje na krátko platí pro hlášení vykazující obchody s jednotlivými zákazníky, nikoli pro hlášení o sdružených obchodech na trhu. Proto, pokud zákazníci nebo jeden ze zákazníků prodává na krátko, ukazatel prodeje na krátko zůstane v hlášení o sdružených obchodech na trhu prázdný, protože

²⁷ Jak definuje čl. 2 odst. 1 písm. b) nařízení (EU) č. 236/2012.

se toto hlášení nevztahuje k jednotlivému zákazníkovi, ale ke všem zákazníkům, jejichž pokyny byly sdruženy.

Případy, kdy dojde ke sdružení pokynů a jak se použije příznak prodeje na krátko, viz oddíly 5.23, 5.24 a 5.27.2.

5.15.1 Zákazník Investičního podniku X prodává na krátko (informace známá podniku X)

Příklad 34

Investiční podnik X prodává akcie na účet Zákazníka A. Zákazník A prodává na krátko.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o prodeji na krátko?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Zákazníka A	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
18	Prodávající – jméno (jména)		<Sellr> <AcctOwnr>
19	Prodávající – příjmení		<Id>
20	Prodávající – datum narození		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id>
62	Ukazatel prodeje na krátko	,'SESH'	</AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

5.15.2 Investiční podnik X prodává na krátko svým vlastním jménem

Příklad 35

Investiční podnik X prodává státní dluhopisy svým vlastním jménem.

5.15.2.1 Obchod probíhá na základě výjimky

Obchod probíhá v souladu s výjimkou o tvorbě trhu nebo primárním trhu podle článku 17 nařízení (EU) č. 236/2012.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o prodeji na krátko?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
----	------	---------	----------------

4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SSEX</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> ... </New> </Tx> </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	
29	Postavení	,DEAL'	
62	Ukazatel prodeje na krátko	,SSEX'	

5.15.2.2 Obchod neprobíhá na základě výjimky

Obchod neprobíhá v souladu s výjimkou o tvorbě trhu nebo primárním trhu podle článku 17 nařízení (EU) č. 236/2012.

Jak hlásí Investiční podnik X informace o prodeji na krátko?

Č.	Pole	Hodnoty	Znárodnění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> ... </New> </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	
62	Ukazatel prodeje na krátko	,SESH'	

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

5.16 Blok 9: Ukazatele výjimky, poobchodní ukazatele OTC a ukazatele komoditních derivativů

5.16.1 Ukazatel výjimky a poobchodní ukazatel OTC

Pole 61 vyplní investiční podnik, který zadal pokyn do obchodního systému nebo který nahlásil obchod do obchodního systému.

Investiční podnik nevyplňuje do pole 63 poobchodní ukazatel OTC ‚CANC‘, protože povinnost uvádět poobchodní ukazatele OTC podle čl. 26 odst. 3 předpokládá existenci obchodu pro účely článku 26 nařízení MiFIR, jak definuje článek 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, a zrušení není považováno za obchod pro účely článku 26 nařízení MiFIR.

5.16.1.1 Obchod provedený v obchodním systému

Příklad 36

Investiční podnik X provádí obchod za zákazníka obchodováním na vlastní účet. Nástroj je akciový nástroj. Investiční podnik X kupuje finanční nástroj v Obchodním systému M a poté ho prodává zákazníkovi.

Nákup v obchodním systému se provádí podle výjimky pro „obchod za referenční cenu“ podle článku 4 nařízení MiFIR. Prodej zákazníkovi je „velkého rozsahu“ podle čl. 20 odst. 3 písm. a) nařízení MiFIR.

Protože tržní strana obchodu se provádí v obchodním systému, hlásí Investiční podnik X pole ukazatele výjimky. Investiční podnik X hlásí rovněž poobchodní ukazatel OTC pro stranu zákazníka obchodu.

Jak hlásí Investiční podnik X ukazatel výjimky a poobchodní ukazatel OTC?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
29	Postavení	‚DEAL‘	‚DEAL‘
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	‚XOFF‘
61	Ukazatel výjimky	‚RFPT‘	
63	Poobchodní ukazatel OTC		‚LRGS‘

Znáznění XML:

Hlášení č. 1 (hlášení na tržní straně)	Hlášení č. 2 (hlášení na straně zákazníka)
<Tx> <New> ...	<Tx> <New>

<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <Wvrlnd>RFPT</Wvrlnd> ... </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 Obchod provedený OTC

Příklad 37

Investiční podnik provede mimoburzovně obchod s akciovým nástrojem s Investičním podnikem Y. Investiční podniky X a Y oba obchodují na vlastní účet. Obchod je v objemu, který se kvalifikuje jako objem velkého rozsahu.

Protože obchod probíhá mimoburzovně, použije se pouze pole Poobchodní ukazatel OTC.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
36	System	,XOFF'	,XOFF'
61	Ukazatel výjimky		
63	Poobchodní ukazatel OTC	,LRGS'	,LRGS'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... </pre>

<pre> ... <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 Obchod provedený mimo knihu pokynů, ale podle pravidel obchodního systému

Příklad 38

Investiční podnik X provede obchod na účet Zákazníka A nákupem akciového nástroje od podniku Y. Obchod se uskuteční mimo knihu pokynů, ale podle pravidel Obchodního systému M. Obchod se provádí podle výjimky „sjednaný obchod s nelikvidními finančními nástroji“ podle čl. 4 odst. 1 písm. b) bod ii nařízení MiFIR.

Investiční podnik Y je členem obchodního systému a vytvořil zprávu o obchodu do obchodního systému, který poté provedl poobchodní transparentní zveřejnění pro obchod.

Investiční podnik Y a Zákazník A jednají na vlastní účet.

Investiční podnik Y vyplní v hlášení o obchodu ukazatel výjimky, protože vytvořil zprávu o obchodu do obchodního systému, a Investiční podnik X může rovněž vyplnit ukazatel výjimky, pokud má informace.

Protože obchod mezi X a Y proběhl podle pravidel obchodního systému, poobchodní ukazatel OTC se v těchto hlášeních nevyplní, protože platí pouze pro obchody neprováděné v obchodním systému.

Zákazník A nevyplňuje ukazatel výjimky, protože nehlásí tržní stranu u obchodu v obchodním systému. Poobchodní ukazatel OTC Zákazník A za žádných okolností nevyplní, protože nejde o samostatný obchod OTC, ale jde o komponentu zákazníka, která je spojena s provedením na trhu, tj. je součástí řetězce.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y a Zákazník A, pokud je Zákazník A investičním podnikem?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení Zákazník A
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Zákazníka A
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A

16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X
29	Postavení	„AOTC“	„DEAL“	„DEAL“
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M	„XOFF“
61	Ukazatel výjimky		„OILQ“	
63	Poobchodní ukazatel OTC			

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y	Hlášení Zákazníka 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> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </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 T</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <Wvrlnd>OILQ</Wvrlnd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </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> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>

5.16.2 Poobchodní ukazatel, pokud investiční podnik páruje dva pokyny zákazníka mimoburzovně

Viz oddíl 5.20.

5.16.3 Ukazatel komoditního derivátu

5.16.3.1 Pokud zákazník uvedl, že snižuje své riziko

Příklad 39

Investiční podnik X provedl obchod na účet Zákazníka 3, který je nefinančním subjektem, s komoditním derivátem, jak definuje čl. 2 odst. 1 bod 30 nařízení MiFIR, kdy Zákazník 3 uvedl, že snižuje své riziko objektivně měřitelným způsobem podle článku 57 směrnice 2014/65/EU. Investiční podnik X jedná v „jakémkoli jiném postavení“.

Jak hlásí Investiční podnik X ukazatel komoditního derivátu?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
29	Postavení	'AOTC'	<Tx>
64	Ukazatel komoditního derivátu	,true'	<New> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> ... </Tx>

Pokud Zákazník 3 nesdělil Investičnímu podniku X, že snižuje své riziko objektivně měřitelným způsobem podle článku 57 směrnice 2014/65/EU, vyplní Investiční podnik X v poli 64 „false“.

5.16.3.2 Pokud nástroj není komoditním derivátem

Příklad 40

Investiční podnik X provedl na účet Zákazníka 3 obchod s nástrojem, který není komoditním derivátem podle čl. 2 odst. 1 bodu 30 nařízení (EU) č. 600/2014.

Jak hlásí Investiční podnik X ukazatel komoditního derivátu?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
29	Postavení	'AOTC'	<Tx>
64	Ukazatel komoditního derivátu		<New> ... <Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx>

Protože nástroj není komoditním derivátem podle čl. 2 odst. 1 bodu 30 nařízení MiFIR, pole 64 není relevantní a nevyplňuje se.

5.17 Blok 10: Pobočky

5.17.1 Obchod provedený na účet zákazníka

Příklad 41

Nizozemský investiční podnik, Investiční podnik D, má LEI 13579135790246802468. Má pobočky v Paříži (FR), Londýně (GB) a Frankfurtu (DE). Přijímá pokyn od španělského zákazníka, Zákazníka E, přes Obchodníka 7, k nákupu určitého finančního nástroje. Zákazník E má LEI 24242424242424242424. Zákazník pošle pokyn pobočce v Paříži. Pobočka v Paříži předá pokyn obchodnímu oddělení v Londýně. Obchodník 8 se pod dohledem londýnské pobočky rozhodne provést pokyn v Obchodním systému M. Obchodník 7 je francouzský státní příslušník Jean Bernard s datem narození 4. května 1972. Obchodník 8 je státní příslušník Spojeného království s číslem národního pojištění Spojeného království QQ123456C. Držitelem členství v Obchodním systému M je pobočka ve Frankfurtu²⁸.

Hlášení o obchodu se předkládá do AFM (NL).

Jak hlásí Investiční podnik D a Zákazník E pole pro pobočku, pokud Zákazník E má oznamovací povinnost a obchoduje na vlastní účet?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik D	Hodnoty hlášení Zákazník E
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku D	{LEI} Zákazníka E
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka E	{LEI} Zákazníka E
8	Země pobočky u kupujícího	'FR'	
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku D
17	Země pobočky u prodávajícího		

²⁸ V některých jurisdikcích je možný, a v některých případech dokonce běžný postup, aby (místní) pobočka byla členem trhu.

29	Postavení	,AOTC'	,DEAL'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'
37	Členství země pobočky	,DE'	
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{NATIONAL_ID} Obchodníka 7
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí		,ES'
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 8	{NATIONAL_ID} Obchodníka 7
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,GB'	,ES'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku D	Hlášení zákazníka E
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>13579135790246802468</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> <CtryOfBrnc>FR</CtryOfBrnc> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnc>DE</CtryOfBrnc> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnc>GB</CtryOfBrnc> <Othr> <Id>QQ123456C </Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>24242424242424242424</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>13579135790246802468</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnc>ES</CtryOfBrnc> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnc>ES</CtryOfBrnc> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Pole 17 nevyplní ani Investiční podnik D, ani Zákazník E, protože toto pole se vyplňuje pouze v případě, kdy je v poli prodávajícího vyplněn zákazník provádějícího investičního podniku. Podobně se nevyplní ani pole 8 v hlášení o obchodu Zákazníka E, protože Zákazník E nemá v poli 7 vyplněného základního zákazníka.

Pole 57 v hlášení Investičního podniku D je prázdné, protože Investiční podnik D jedná v „jakémkoli jiném postavení“. Pole 58 se nemusí v hlášení Investičního podniku D vyplnit, protože pole 57 je prázdné.

Pole 58 vyplní zákazník kódem země pro sídlo Zákazníka E (ES), protože nebyla zapojena žádná pobočka.

5.17.2 Obchod provedený na vlastní účet

Příklad 42

Obchodník 7 pod dohledem sídla španělského Investičního podniku E s LEI 12312312312312312312, který má pobočky v Paříži (FR), Londýně (GB) a Frankfurtu (DE), se rozhodne prodat určitý finanční nástroj. Obchodník 7 se rozhodne, že provede pokyn v Obchodním systému M. Držitelem členství v Obchodním systému M je pobočka ve Frankfurtu.

Hlášení o obchodu se předkládá do CNMV (ES).

Jak hlásí Investiční podnik E pole pro pobočku?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku E	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	<ExctgPty>12312312312312312312</ExctgPty> ...
8	Země pobočky u kupujícího		<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku E	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
17	Země pobočky u prodávajícího		</Buyr> <Sellr>
29	Postavení	„DEAL“	<AcctOwnr>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	<Id> <LEI>12312312312312312312</LEI> </Id>
37	Členství země pobočky	„DE“	</AcctOwnr> </Sellr>
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 7	...
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	„ES“	<Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ...
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 7	<TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> ...

60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,ES'	<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>
----	---	------	---

Pole 17 je prázdné, protože toto pole se vyplňuje, pokud je u zákazníka vyplněn prodávající.

5.17.3 Obchod prováděný pobočkami v Evropském hospodářském prostoru u podniků mimo Evropský hospodářský prostor

Příklad 43

Obchodník pod dohledem sídla amerického podniku, Podniku F s LEI 22222222222222222222 a pobočkami v Paříži (FR), Londýně (GB) a Frankfurtu (DE), se rozhodne koupit určitý finanční nástroj. Obchod se provádí v Obchodním systému M prostřednictvím obchodníka. Držitelem členství v Obchodním systému M je pobočka ve Frankfurtu. Podnik obchoduje na svůj vlastní účet.

Jak hlásí Podnik F pole pro pobočku?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Podniku F	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Podniku F	<pre> <ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> </pre>
8	Země pobočky u kupujícího		<pre> ... <Buyr> </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro	<pre> <AcctOwnr> <Id> </pre>

		Obchodní systém M	<LEI>22222222222222222222</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
17	Země pobočky u prodávajícího		
29	Postavení	,DEAL'	
36	System	Segment {MIC} Obchodního systému M	
37	Členství země pobočky	,DE'	
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	,US'	
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,US'	

Pole 8 a 17 (země pobočky u kupujícího a prodávajícího) jsou prázdná, protože tato pole se vyplňují pouze v případě, kdy jsou kupující a prodávající vyplnění zákazníky.

U hlášení obchodů se musí předem provést rozhodnutí o příslušném orgánu, kterému bude předloženo hlášení o obchodu. Tento příslušný orgán nemusí být příslušným orgánem, který autorizoval pobočky zapojené v tomto obchodě, ale jde o jeden z příslušných orgánů, které autorizovaly pobočku podniku v souladu se společným výběrem podniku třetí země podle článku 14 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. V příkladu uvedeném výše by mohlo být hlášení o obchodu předloženo příslušným orgánům Spojeného království, Francie nebo Německa.

Podle nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, pokud pobočka v Evropském hospodářském prostoru podniku mimo Evropský hospodářský prostor provede činnost stanovenou v článku 3, tato pobočka provádí a musí hlásit obchody. V tomto případě provádí německá pobočka, protože obchoduje na trhu, a proto Podnik F vyplní hlášení o obchodu, jak je stanoveno výše.

5.18 Blok 11: Status hlášení o obchodech a oprav

Status ‚NEWT‘ v poli 1 se používá pro obchod ještě nenahlášený a pro opravu nepřesného hlášení o obchodu po zrušení původního hlášení o obchodu.

Status ‚CANC‘ se používá pro zrušení hlášení o obchodech u obchodů, které nemusí být hlášeny a pro zrušení hlášení o obchodech, která obsahují chyby, před vytvořením nahrazujícího hlášení o obchodu.

Referenční čísla obchodů (TRN) musí být jedinečná pro provádějící investiční podnik u každého hlášení o obchodu. V případech, kdy je zapojen jeden nebo více schválených mechanismů pro hlášení obchodů, se referenční čísla obchodů vždy generují na úrovni provádějícího investičního podniku. Referenční číslo obchodu se nepoužívá opakovaně, s výjimkou případu, kdy je původní hlášení o obchodu opravováno nebo zrušeno; v takovém případě se u nahrazujícího hlášení použije stejné referenční číslo obchodu jako u původního hlášení, které se nahrazuje (viz oddíly 5.18.3 a 5.18.4). Referenční číslo obchodu se znovu použije u každé následné opravy stejného hlášení o obchodu. Může se stát, že existuje více než jeden záznam (nový nebo zrušení), které souvisejí se stejným obchodem (se stejným referenčním číslem obchodu a identifikačním kódem subjektu provádějícího obchod), které se zahrnou do jednoho souboru. V takovém případě se pořadí hlášení v souboru řídí logikou zpracování hlášení, tj. že (i) lze zrušit pouze obchod, který byl již dříve nahlášen jako nový obchod a nebyl ještě zrušen a (ii) obchod se stejnou identifikací (stejným referenčním číslem obchodu a stejným identifikačním kódem subjektu provádějícího obchod) lze ohlásit pouze v případě, že bylo zrušeno předchozí hlášení pro tento obchod. Zejména se musí zvážit následující případy:

- a) nový obchod je nahlášen a ihned zrušen (obě hlášení jsou předložena ve stejném souboru) -> nové hlášení o obchodu se v souboru zařadí před hlášení o zrušení;
- b) obchod, který byl nahlášen v jednom z předchozích souborů, je zrušen a současně je předložena nová verze tohoto obchodu (zrušení předchozího hlášení a nová verze jsou předloženy ve stejném souboru) -> zrušení předchozího hlášení o obchodu se v souboru zařadí před nové hlášení o obchodu (novou verzí obchodu);
- c) kombinace výše uvedených okolností (tj. více než jedno nové hlášení nebo hlášení o zrušení ve vztahu k jednomu obchodu) -> podle okolností (a nebo b výše) bude první záznam zařazený v souboru buď o novém obchodu, nebo o zrušení obchodu a následující záznamy se seřadí tak, aby za každým záznamem následoval záznam opačného typu.

5.18.1 Rušení a změny během dne

Pokud investiční podnik provádí poobchodní zveřejňování a zruší poobchodní zveřejnění před vytvořením hlášení o obchodu, není provedení hlášení o obchodu vyžadováno.

Pokud investiční podnik provádí poobchodní zveřejňování, které se mění před vytvořením hlášení o obchodu, musí hlášení o obchodu odrážet pouze informace o posledním poobchodním zveřejnění.

5.18.2 Předložení nového hlášení o obchodu

Příklad 44

Investiční podnik X provede mimoburzovní obchod dne 10. března 2018 ve 12:45:30. Hlášení o obchodu je předloženo prostřednictvím schváleného mechanismu pro hlášení obchodů, ARM 1 (LEI ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1). Referenční číslo obchodu je ETYRU9753.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty Původní hlášení	Znázornění XML
1	Status hlášení	‚NEWT‘	<Tx>
2	Referenční číslo obchodu	‚ETYRU9753‘	<New> <TxId>ETYRU9753</TxId>
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1	... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1 ARM1</SubmitgPty> ...
28	Datum a čas obchodování	‚2018-03- 10T12:45:30Z‘	<Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> </Tx> ... </New> </Tx> <i>Upozorňujeme, že pole 1 ve zprávě neexistuje jako prvek XML. Místo něj se používá značka New nebo Cxl.</i>

5.18.3 Předložení zrušení

Příklad 45

Investiční podnik X předloží nové hlášení o obchodu (podrobnosti jako v oddíle 5.18.2) pomocí schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1 (LEI ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1) a následně toto hlášení o obchodu zruší.

Je třeba upozornit, že rušení může provést jiný subjekt podávající hlášení než ten, který předložil původní hlášení. Investiční podnik mohl například použít jeden schválený mechanismus pro hlášení obchodů k předložení původního hlášení a může sám toto hlášení zrušit nebo použít jiný schválený mechanismus pro hlášení obchodů.

U rušení se vyplní pouze klíčová pole 1, 2, 4 a 6. Podniky nemohou opakovaně předložit úplné hlášení. Pokud je hlášení o obchodu předloženo opakovaně s více poli kromě klíčových polí, bude zamítnuto.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty původního hlášení	Hodnoty rušícího hlášení
1	Status hlášení	,NEWT'	,CANC'
2	Referenční číslo obchodu	,ETYRU9753'	,ETYRU9753'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1

Znázornění XML:

Původní hlášení	Rušící hlášení
<pre><Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1 </SubmitgPty> ... </New> </Tx></pre> <p><i>Upozorňujeme, že pole 1 ve zprávě neexistuje jako prvek XML. Místo něj se používá značka New nebo Cxl.</i></p>	<pre><Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx></pre> <p><i>Upozorňujeme, že pole 1 ve zprávě neexistuje jako prvek XML. Místo něj se používá značka New nebo Cxl.</i></p>

5.18.4 Oprava informací v hlášení o obchodu

Při opravě informací v hlášení o obchodu se musí zrušit původní hlášení a předložit hlášení nové.

U rušení se vyplní pouze klíčová pole 1, 2, 4 a 6. Rušící hlášení o obchodu, které obsahuje jiná pole kromě těchto čtyř, bude zamítnuto.

Náhradní hlášení musí mít všechna pole, které jsou relevantní pro hlášený obchod.

Příklad 46

Investiční podnik X provedl obchod v 5.18.2 s cenou 5 GBP, ale obchod nahlásil s cenou v menší, nikoli větší měnové jednotce (pence nikoli libry).

Hlášení o obchodu je zrušeno příštího dne ve 14:50:20 a současně je předloženo náhradní hlášení s cílem opravit cenu.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty původního hlášení	Hodnoty rušícího hlášení	Hodnoty náhradního hlášení
1	Status hlášení	,NEWT'	,CANC'	,NEWT'
2	Referenční číslo obchodu	,ETYRU9753'	,ETYRU9753'	,ETYRU9753'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1	{LEI} schváleného mechanismu pro hlášení obchodů ARM 1
28	Datum a čas obchodování	,2018-03-10T12:45:30Z'		,2018-03-10T12:45:30Z'
33	Cena	,500'		,5'

Znázornění XML:

Původní hlášení	Rušící hlášení	Náhradní hlášení
<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">500</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> <Cxl> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Tx> </New> </Tx> </pre>

Upozorňujeme, že datem a časem je datum a čas původního hlášení, tj. „2018-03-10T12:45:30Z“, nikoli datum a čas opravného hlášení. Upozorňujeme také, že stejně jako v celých těchto pokynech musí původní a náhradní hlášení obsahovat všechny ostatní údaje relevantní pro daný obchod a že v příkladech uvedených výše jsou obsaženy pouze výňatky z hlášení.

5.19 Blok 12: Změna pomyslné hodnoty

5.19.1 Navýšení pomyslné hodnoty

Příklad 47

Investiční podnik X prodá zajištění Investičnímu podniku Y dne 26. října 2018 v 08:21:01 v hodnotě 2 miliony EUR ve swapu úvěrového selhání. Swap úvěrového selhání má pevný kupón 100bps a platbu předem ve výši 50 000 EUR přijatou Investičním podnikem X. Investiční podnik X a Podnik Y jednájí na vlastní účet.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
2	Referenční číslo obchodu	,12456771'	,39998776'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-10-26T08:21:01Z'	,2018-10-26T08:21:01Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,2000000'	,2000000'
32	Navýšení/snížení pomyslné hodnoty derivátů		
33	Cena	,100'	,100'
38	Platba předem	,50000'	,50000'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku 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> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998776</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> </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> <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>
--	---

Upozorňujeme, že platba předem (pole 38) vykazuje kladnou hodnotu v hlášení o obchodu Investičního podniku X i Podniku Y, podniku kupujícího zajištění, protože prodávající swapu úvěrového selhání je příjemcem částky.

Dne 25. listopadu 2018 v 10:52:03 se strany výše uvedené smlouvy o swapu úvěrového selhání dohodly, že navýší pomyslnou hodnotu na 5 milionů EUR a že stanoví další platbu přijatou Investičním podnikem X ve výši 75 000 EUR. Kupónové platby zůstávají beze změny.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y navýšení pomyslné hodnoty?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
2	Referenční číslo obchodu	,124567981'	,399987981'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-11-25T10:52:03Z'	,2018-11-25T10:52:03Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,3000000'	,3000000'
32	Navýšení/snížení pomyslné hodnoty derivátů	,INCR'	,INCR'
33	Cena	,100'	,100'
38	Platba předem	,75000'	,75000'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku 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> <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> <New> <TxId>399987981</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>2018-11- 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>

Referenční číslo obchodu (pole 2) pro navýšení u tohoto hlášení o obchodu je jedinečné , nikoli stejné jako u původního hlášení o obchodu.

Množství (pole 30) je částka navýšení pomyslné hodnoty. Pokud došlo ke změně kupónových plateb po změně pomyslné hodnoty, nový kupón se uvede v poli Cena (pole 33).

Upozorňujeme, že datem a časem jsou datum a čas navýšení, nikoli datum a čas původního obchodu.

Původní hlášení o obchodu se neruší.

Hlášení o původním obchodu a hlášení o navýšení pomyslné hodnoty společně uvádějí, že Investiční podnik X prodal zajištění své protistraně za 5 milionů EUR.

5.19.2 Snížení pomyslné hodnoty

5.19.2.1 Částečné předčasné ukončení

Příklad 48

Podobně jako v předchozím příkladu, ale namísto navýšení pomyslné hodnoty, se dne 25. listopadu 2018 v 10:52:03 strany dohodly, že sníží pomyslnou hodnotu o 0,5 milionu EUR na 1,5 milionu EUR, přičemž Investiční podnik X zaplatí 37 500 EUR za snížení.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
2	Referenční číslo obchodu	,124567852'	,39998792'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
28	Datum a čas obchodování	,2018-11-25T10:52:03Z'	,2018-11-25T10:52:03Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,500000'	,500000'
32	Navýšení/snížení pomyslné hodnoty derivátů	,DECR'	,DECR'
33	Cena	,100'	,100'
38	Platba předem	,37500'	,37500'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> <TxId>124567852</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998792</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </Id> </AcctOwnc> </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> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </Id> </AcctOwnc> </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> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

Platba předem je v obou hlášení kladná, protože ačkoli Investiční podnik X nyní platí, nikoli přijímá platbu, prodávajícím v tomto hlášení je Y, a proto prodávající přijímá platbu.

Protože expozice se snižuje a Investiční podnik X původně prodával, Investiční podnik X nyní kupuje.

Množství (pole 30) je částka snížení pomyslné hodnoty. Pokud došlo ke změně kupónových plateb po změně pomyslné hodnoty, nový kupón se zobrazí v poli Cena (pole 33).

Upozorňujeme, že datem a časem je datum a čas snížení, nikoli datum a časem původního obchodu.

Hlášení o původním obchodu a hlášení o snížení pomyslné hodnoty společně uvádějí, že Investiční podnik X prodal zajištění za 1,5 milionu EUR. Původní hlášení se neruší.

5.19.3 Úplné předčasné ukončení

Pokud se strany dohodnou na úplném předčasném ukončení smlouvy, potom by se pomyslná hodnota snížila o celou částku původní smlouvy.

Část III – Obchodní scénáře

5.20 Převod cenných papírů

5.20.1 Převod mezi zákazníky v rámci stejného podniku

Jak bylo uvedeno v části I, pokud se nezmění vlastnictví základního zákazníka, neprovádí se žádné hlášení o obchodu. To platí bez ohledu na to, zda k převodu dojde v rámci stejného investičního podniku nebo mezi dvěma různými investičními podniky nebo investičním podnikem a podnikem, pokud jsou vlastníci přesně titíž.

Pokud investiční podnik provede převod mezi účty, který vede k obchodu, má se za to, že provedl obchod podle článku 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Pokud však jediné zapojení investičního podniku spočívá v poskytování administrativní pomoci, a nikoli provedení převodu, nepovažuje se to za provádění obchodu podnikem.

Převody z účtu ve vlastnictví zákazníka na společný účet, kdy zákazník je jedním ze společných vlastníků, musí být nahlášeny. Podobně musí být hlášen případ, kdy se společný účet změní na účet pouze s jediným vlastníkem.

Tento princip rovněž platí pro převody ze společných portfolií na samostatná portfolia, rozdělování od **svěřenských fondů** oprávněným osobám, převody z účtů od rodičů držících účty za nezletilé děti, když nezletilé děti dosáhnou zletilosti, převody (nebo zpětné prodeje) na obchodní firmu ve vlastnictví jednotlivce od uvedeného jednotlivce, převody na dobročinnost a vyplývající z aukcí nebo z párování kupujícího a prodávajícího investičním podnikem.

Převody v souvislosti s pohyby, k nimž dochází při správě soudně potvrzené závěti zesnulých zákazníků nebo dědiců, aukcemi a dary, musí být všechny hlášeny, protože tyto obchody představují nabytí a pozbytí, kdy dochází ke změně vlastnictví, přestože není stanovena žádná cena, včetně změny vlastnictví účtu cenných papírů z jedné oprávněné osoby na druhou.

Pole Cena odráží zaplacenou cenu, i když se může lišit od ceny tržní. Pokud dochází k převodu finančních nástrojů a žádná cena se neplatí (např. dary nebo převody mezi fondy / portfolii cenných papírů), v poli Cena se vyplní „NOAP“.

Příklad 49

Zákazník A chce převést nástroje na účet Zákazníka B bez přijetí platby. Nehradí se žádné poplatky. Oba účty vlastní stejný investiční podnik (podnik X), který provádí převod.

Jak hlásí Investiční podnik X tento převod?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka B	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Zákazníka A	>
33	Cena	,NOAP'	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre> <p>—Upozorňujeme, že pokud není cena relevantní, použije se kód NOAP.</p>

Datum a čas v hlášení jsou datem a časem, kdy Investiční podnik X provedl převod.

5.20.2 Převody mezi zákazníky dvou samostatných investičních podniků

Příklad 50

Zákazník A chce převést 100 finančních nástrojů ze svého účtu u Investičního podniku X na účet Zákazníka B, vedeného u jiného investičního podniku, Podniku Y. Pokyn Zákazníka A je vydán Investičnímu podniku X a proveden dne 2018-10-05 v 09:53:17. Investiční podnik X ani Investiční podnik Y neznají navzájem totožnost svých zákazníků.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Zákazníka B
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-10-05T09:53:17Z'	,2018-10-05T09:53:17Z'
30	Množství	,100'	,100'
33	Cena	,NOAP'	,NOAP'
34	Měna, v níž je uvedena cena		

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>

Investiční podnik X a Investiční podnik Y hlásí čas, kdy provedly převod, a tyto časy se mohou lišit. Pole 28, Datum a čas obchodování, odráží datum a čas obchodu, nikoli čas předání pokynu.

5.20.3 Podniky jednající mimoburzovně při párování pokynů dvou zákazníků

Příklad 51

Investiční podnik X provádí mimoburzovní obchod za Zákazníka A, kupujícího, a Zákazníka B, prodávajícího. Na žádného ze zákazníků se nevztahuje oznamovací povinnost. Obchod podléhá poobchodnímu zveřejnění s poobchodním ukazatelem OTC nastaveným na „ACTX“ (duální obchod).

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Zákazníka B	... <Buyr> <AcctOwnr>
36	System	„XOFF“	<Id>
63	Poobchodní ukazatel OTC	„ACTX“	<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>

Příklad 52

Investiční podnik X provádí mimoburzovní obchod za Zákazníka A, kupujícího, a Zákazníka B, prodávajícího. Zákazník B je investiční podnik, na který se vztahuje oznamovací povinnost. Zákazník B nemá žádného základního zákazníka.

Jak hlásí Investiční podniky X a B?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik B
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku B
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku B	{LEI} Investičního podniku B
29	Postavení	„AOTC“	„DEAL“
36	System	„XOFF“	„XOFF“
63	Poobchodní ukazatel OTC	„ACTX“	

Znáznění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku 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> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</E xctgPty> ... <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> </pre>

<pre> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Kdyby Zákazník A byl investiční podnik, na který se vztahuje oznamovací povinnost, musel by identifikovat ve svém hlášení o obchodu Investiční podnik X jako prodávajícího.

5.21 Investiční podnik představující bez vstupování

5.21.1 Investiční podnik páruje dva pokyny od zákazníků bez toho, aniž by mezi ně vstoupil

Příklad 53

Investiční podnik X chce prodat daný nástroj na vlastní účet.

Investiční podnik Y chce koupit tentýž nástroj na vlastní účet.

Investiční podnik Z svede dohromady Investiční podniky X a Y, ale není stranou obchodu.

Investiční podniky X a Y se dohodnou mezi sebou na podrobnostech obchodu.

Investiční podnik Z nemá oznamovací povinnost, naopak podniky X a Y hlášení předkládají.

Investiční podnik X ví v okamžiku provádění, že jeho protistranou je Y.

Investiční podnik Y ví v okamžiku provádění, že jeho protistranou je X.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investičního podniku X	Hodnoty hlášení Investičního podniku Y
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
29	Postavení	„DEAL“	„DEAL“

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> </pre>

<pre> <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

5.21.2 Investiční podnik představující svého zákazníka jinému investičnímu podniku, aniž by mezi ně vstupoval

Příklad 54

Zákazník A chce koupit daný nástroj. Jeho zprostředkovatel, podnik X, neobchoduje s těmito nástroji a představí Zákazníka A Investičnímu podniku Y.

Investiční podnik Y nakoupí finanční nástroje za Zákazníka A v Obchodním systému M. Investiční podnik Y ví v okamžiku provádění, že Zákazník A je jeho zákazníkem, a Zákazník A ví, že má při tomto obchodu vztah s Investičním podnikem Y. Investiční podnik X nemá žádnou roli při provádění a pouze obdržel od Investičního podniku Y provizi za představení.

Protože Investiční podnik X neprováděl, obchod nehlásí.

Jak hlásí Investiční podnik Y?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<pre> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNORST</Exc tgPty> ... </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </pre>

			<pre> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Pokud je Zákazník A investiční podnik, pak rovněž hlásí obchod a identifikuje Investiční podnik Y jako prodávajícího.

Tento případ se liší od předání v souladu s podmínkami článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, protože v tomto scénáři základní zákazník navazuje vztah s podnikem, kterému je představen. Investiční podnik X efektivně předá vztah Investičnímu podniku Y. To je rozdíl oproti situaci, kdy vztah zůstává u prodávajícího podniku a kdy se předávají pouze údaje o zákazníkovi.

5.22 Jeden pokyn jednoho zákazníka prováděný ve více obchodech

5.22.1 Provedení pokynu zákazníka provedením v systému a poté poskytnutím zákazníkovi z vlastního portfolia investičního podniku

Příklad 55



Zákazník A dává pokyn k nákupu 500 akcií Investičnímu podniku X.

Investiční podnik X provede pokyn v Obchodním systému M ve dvou obchodech, jednom dne 24. června 2018 v 14:25:13.159124 na 300 akcií za 99 SEK a jedním dne 24. června 2018 v 15:55:13.746133 na 200 akcií za 100 SEK. Zákazník chce obdržet průměrnou cenu.

- a) Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet

Obchody se nejprve zaknihují ve vlastním portfoliu Investičního podniku X a poté se později zaknihují zákazníkovi v 16:24:12 ve stejný den za objemově váženou průměrnou cenu 99,40 SEK.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T14:25:13.159Z'	,2018-06-24T15:55:13.746Z'	,2018-06-24T16:24:12Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,300'	,200'	,500'
33	Cena	,99'	,100'	,99,40'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 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> </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> </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><Tra </pre>

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

b) Investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka A
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M
20	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T14:25:13.159'	,2018-06-24T15:55:13.746'
29	Postavení	,MTCH'	,MTCH'
30	Množství	,300'	,200'
33	Cena	,99'	,100'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </pre>

<pre> <Sellr> <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> </AcctOwnr> </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>
--	---

Ačkoli zákazník požaduje průměrnou cenu, v hlášeních o obchodech se musí uvést, že každé jednotlivé provedení na trhu je okamžitě předáno zákazníkovi, protože investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet.

c) Investiční podnik obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“

Hlášení o obchodech Investičního podniku X obchodujícího v „jakémkoli jiném postavení“ jsou přesně stejná jako hlášení pro obchodování párováním pokynů na vlastní účet uvedená výše, pouze postavení se hlásí jako „AOTC“, nikoli „MTCH“.

5.22.2 Provedení pokynu zákazníka získáním části ze systému a poskytnutím nástrojů zákazníkovi z vlastního portfolia investičního podniku

Příklad 56

Zákazník A dává pokyn k nákupu 600 akcií Investičnímu podniku X. Zákazník chce obdržet průměrnou cenu.

Investiční podnik X provede pokyn Zákazníka A takto:

- 1) Provede dva obchody v Obchodním systému M, jeden dne 24. června 2018 ve 14:25:13.159124 na 300 akcií za 99 SEK a jeden dne 24. června 2018 v 15:55:13.746133 na 200 akcií za 100 SEK.
- 2) Investiční podnik X poskytne 600 akcií zákazníkovi v 16:24:12 ve stejný den za průměrnou cenu 99,416 SEK.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2	Hodnoty hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X
20	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T14:25:13.159Z'	,2018-06-24T15:55:13.746Z'	,2018-06-24T16:24:12Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,300'	,200'	,600'
33	Cena	,99'	,100'	,99.4166666666666666'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 (na tržní straně)	Hlášení č. 2 (na tržní straně)	Hlášení č. 3 (na straně zákazníka)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</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> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </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> <Id><LEI>11111111111111111111 111</LEI> </Id> </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> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </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">99.4166666666 66</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	---

5.23 Seskupování pokynů

Souhrnný účet zákazníka („INTC“) se použije pouze za okolností stanovených v těchto obecných pokynech. Nepoužívá se pro hlášení pokynu pro jednoho zákazníka provedeného v jediném provedení, ani pro pokyn jednoho zákazníka provedený ve více provedeních. Pokud dochází k převodu na souhrnný účet zákazníka („INTC“), dochází k odpovídajícímu převodu ze souhrnného účtu zákazníka ve stejný obchodní den provádějícího subjektu v hlášení o obchodu, takže souhrnný účet zákazníka je neutrální. Zdanlivý pohyb prostřednictvím „INTC“ je konvence používaná pro hlášení, aby se u obchodů zajistilo spojení mezi tržní stranou a stranou zákazníka, a nemusí naznačovat, že tento účet zákazníka ve skutečnosti existuje, ani že vlastnictví nástroje skutečně prochází účetnictvím investičního podniku.

Ustanovení čl. 11 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 uvádí, že pokud investiční podnik seskupí pokyny od několika zákazníků, uplatní se požadavky na prodej na krátko podle nařízení (EU) č. 236/2012. To znamená, že čl. 11 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 se uplatní pouze u hlášení uvádějících obchody s jednotlivými zákazníky, nikoli u souhrnného hlášení o obchodech na trhu. V případě tržní strany hlášení o obchodech sdružujícího obchody u prodávajících zákazníků, bude ukazatel prodeje na krátko prázdný. Důvodem je to, že souhrnné hlášení o obchodech na trhu se týká všech zákazníků, jejichž pokyny byly sdruženy, a nemůže uvádět ukazatel prodeje na krátko s nezbytnou podrobností. Ukazatel prodeje na krátko u jednotlivých zákazníků se namísto toho hlásí v jednotlivých hlášeních o obchodech na straně zákazníka (viz oddíl 5.24 a 5.27.2).

5.23.1 Jedno provedení na trhu za několik zákazníků

Příklad 57

Dva zákazníci Investičního podniku X, Zákazník A a Zákazník B, zadají pokyny k prodeji na 100 a 200 akcií.

Zákazník A prodává na krátko. Zákazník B nesdělí Investičnímu podniku X, zda prodává na krátko. Investiční podnik X je neutrální. Investiční podnik X seskupí pokyny a provede je dne 16. září 2018 v 09:20:15.374215 v Obchodním systému M v jednom obchodu na 300 za 25,54 EUR. Ten potom alokuje obchody zákazníkům v 09:35:10.

5.23.1.1 Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-16T09:20:15.374Z'	,2018-09-16T09:35:10Z'	,2018-09-16T09:35:10Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,300'	,100'	,200'
33	Cena	,25,54'	,25,54'	,25,54'
36	System	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'
62	Ukazatel prodeje na krátko	,SESH'	,SESH'	,UNDI'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCp cty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234567890< /LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpct y> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellg Ind> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>UNDI</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Protože by prodej na trh vedl k tomu, že by Investiční podnik X měl krátkou pozici, potřeboval by Investiční podnik X vyplnit hlášení č. 1, kde by toto uvedl, bez ohledu na skutečnost, že po nakupech od zákazníků by byl Investiční podnik X neutrální (viz 5.27.2).

5.23.1.2 Investiční podnik X obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	,INTC'	,INTC'
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-16T09:20:15.374Z'	,2018-09-16T09:20:15.374Z'	,2018-09-16T09:20:15.374Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,300'	,100'	,200'
33	Cena	,25,54'	,25,54'	,25,54'
36	System	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'
62	Ukazatel prodeje na krátko		,SESH'	,SELL'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789012345 67890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> ... </pre>

<pre> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <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> ... <TradgCpcty>AOTC</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> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</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> </pre>
---	--	--

Cena a datum a čas obchodování jsou u všech tří hlášení o obchodech stejné. Cena a datum a čas obchodování jsou tržní cena a datum a čas provedení na trhu. Hlášení č. 2 a č. 3 ukazují alokace zákazníkům u obchodu provedeného v obchodním systému v „jakémkoli jiném postavení“. Proto podrobnost data a času u provedení na trhu přetrvává v hlášení o alokacích zákazníkům.

5.23.2 Několik provedení na trhu za několik zákazníků

Příklad 58

Tři zákazníci Investičního podniku X – Zákazník A, Zákazník B a Zákazník C – zadají pokyny k nákupu 100, 200 a 300 nástrojů.

Investiční podnik X souhlasí, že poskytne svým zákazníkům průměrnou cenu a sdruží pokyny uvedené výše, a realizuje je ve dvou obchodech v Obchodním systému M, jednom na 400 za 99 SEK (datum a čas: 15. září 2018 v 11:32:27.431) a jednom na 200 za 100 SEK (datum a čas: 15. září 2018 v 11:42:54.192). Obchody alokuje zákazníkům v 12:15:23 téhož dne.

5.23.2.1 Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet

Jak hlásí Investiční podnik X obchody na straně trhu?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:42:54.192Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,400'	,200'
33	Cena	,99'	,100'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 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> </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> </pre>

... </New> </Tx>	... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>
------------------------	--

Jak hlásí Investiční podnik X obchody vůči zákazníkům?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 3	Hodnoty hlášení č. 4	Hodnoty hlášení č. 5
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B	{LEI} Zákazníka C
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-15T12:15:23Z'	,2018-09-15T12:15:23Z'	,2018-09-15T12:15:23Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,100'	,200'	,300'
33	Cena	,99,33333333333333'	,99,33333333333333'	,99,33333333333333'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znáznění XML:

Hlášení č. 3	Hlášení č. 4	Hlášení č. 5
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC CCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>

<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--

Protože Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet, datum a čas u hlášení na straně zákazníka odráží časy, kdy byly finanční nástroje alokovány zákazníkům.

5.23.2.2 Investiční podnik X obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“

Jak hlásí Investiční podnik X obchody na tržní straně?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	,INTC'
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:42:54.192Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,400'	,200'
33	Cena	,99'	,100'

36	System	Segment {MIC} Obchodního systému M	Segment {MIC} Obchodního systému M
----	--------	------------------------------------	------------------------------------

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 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> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </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> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Jak hlásí Investiční podnik X alokace zákazníkům?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 3	Hodnoty hlášení č. 4	Hodnoty hlášení č. 5
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B	{LEI} Zákazníka C
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	,INTC'	,INTC'
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:32:27.431Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,100'	,200'	,300'
33	Cena	,99,3333333333333333'	,99,3333333333333333'	,99,3333333333333333'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znárodnění XML:

HLÁŠENÍ Č. 3	HLÁŠENÍ Č. 4	HLÁŠENÍ Č. 5
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </pre>

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

Podrobnost data a času u provedení na trhu se dodrží v hlášeních alokací zákazníkům, protože obchody byly provedeny v obchodním systému v „jakémkoli jiném postavení“.

Pokud investiční podnik obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“, datem a časem obchodování pro alokace zákazníkům je datum a čas prvního provedení na trhu, nikoli posledního.

5.23.2.3 Investiční podnik obchoduje párováním pokynů na vlastní účet

Investiční podnik X nesmí použít „MTCH“ pokud provádí obchody v různých časech.

5.23.2.4 Investiční podnik X obchoduje ve smíšeném postavení

Příklad 59

Stejně jako v příkladu uvedeném výše s tím rozdílem, že Investiční podnik X uspokojí část pokynu ze svého vlastního portfolia (200 jednotek za 100 SEK). Protože souhrnný účet zákazníka („INTC“) musí být na konci dne neutrální a Podnik X poskytuje 200 jednotek, aby částečně provedl pokyny několika zákazníků, je třeba sestavit hlášení, které uvádí převod z vlastního účtu podniku X na účet „INTC“, aby se vyvážíla částka na tržní straně a na straně alokace zákazníkům (hlášení č. 2).

Jak hlásí Investiční podnik X obchody na tržní straně?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	‚INTC‘	‚INTC‘
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	‚2018-09-15T11:32:27.431Z‘	‚2018-09-15T11:35:30Z‘
29	Postavení	‚AOTC‘	‚DEAL‘
30	Množství	‚400‘	‚200‘
33	Cena	‚99‘	‚100‘
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	‚XOFF‘

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>

<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> y> ... <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> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </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>
---	---

Jak hlásí Investiční podnik X alokace zákazníkům?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 3	Hodnoty hlášení č. 4	Hodnoty hlášení č. 5
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B	{LEI} Zákazníka C
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	,INTC'	,INTC'
28	Datum a čas obchodování	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:32:27.431Z'	,2018-09-15T11:32:27.431Z'

29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,100'	,200'	,300'
33	Cena	,99,33333333333333 ,	,99,33333333333333'	,99,33333333333333'
36	Systém	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znázornění XML:

Hlášení č. 3	Hlášení č. 4	Hlášení č. 5
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </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">93.33333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </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">93.33333333333333 </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> <IntI>INTC</IntI> </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">93.333333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

<p><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></p>	<p><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></p>	<p><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></p>	<p><New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBB</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></p>
--	--	--	---

U obchodu provedeného dne 25/07/2018:

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2	Hodnoty hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Podniku V	,INTC'	,INTC'
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-25T13:11:11Z'	,2018-07-25T13:11:11Z'	,2018-07-25T13:11:11Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,500'	,150'	,350'
33	Cena	,100,96'	,100,96'	,100,96'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znázornění XML:

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

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

5.23.2.5.2 Pokyny provedené na základě zásady „kdo dřív přijde, bude dřív na řadě“

Vnitřní postupy podniku X při provádění sdružených obchodů upřednostňují časové hledisko při alokaci svým zákazníkům. Protože Investiční podnik X obdržel jako první pokyn od Zákazníka A, obdrží Zákazník A celé množství nástrojů (400 za průměrnou cenu 100,365 EUR) a jeho pokyn bude zcela proveden. Zbývající množství z provedení je pro Zákazníka B.

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3	Hodnoty Hlášení č. 4
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	,INTC'	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Z	,INTC'	,INTC'
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-24T15:33:33Z'	,2018-07-24T17:55:55Z'	,2018-07-24T15:33:33Z'	,2018-07-24T15:33:33Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,200'	,300'	,400'	,100'
33	Cena	,100,21'	,100,52'	,100,365'	,100,52'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3	Hlášení č. 4
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456 78901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> </pre>

<pre> <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</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> </pre>	<pre> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>888888888888888 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> </pre>	<pre> <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> </pre>	<pre> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</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> </pre>
--	---	--	---

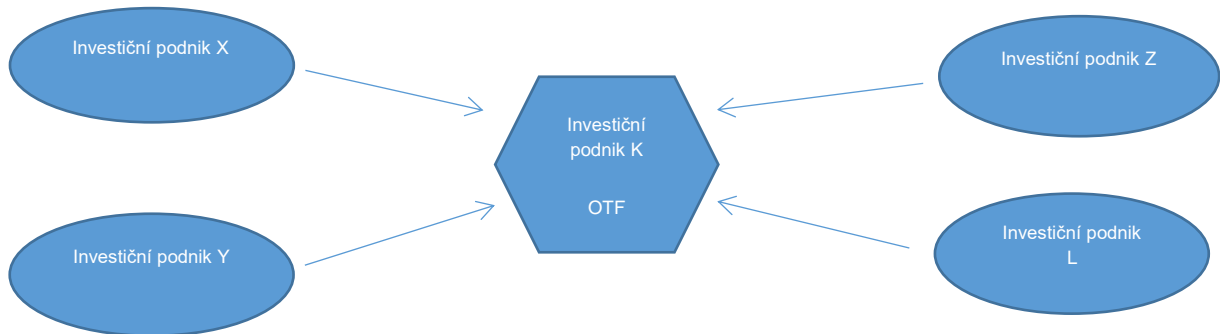
Pokud jde o obchod provedený dne 25/07/2018, ten bude směřován na Zákazníka B a „INTC“ se nepoužije.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka B	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Podniku V	...
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-25T13:11:11Z'	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
29	Postavení	,AOTC'	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id>
30	Množství	,500'	</AcctOwnr>
33	Cena	,100,96'	</Buyr>
36	System	,XOFF'	<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>

5.24 OTF obchodující párováním pokynů na vlastní účet

Pokud OTF obchoduje párováním pokynů na vlastní účet, jedná obdobně jako investiční podnik a hlásí obchody podobným způsobem jako investiční podnik. Všechny strany obchodující s OTF i OTF budou v hlášení uvádět v poli System segment MIC OTF. OTF obchodující párováním pokynů na vlastní účet páruje pokyn na straně nákupu od jednoho nebo více zákazníků s pokyny na straně prodeje od jednoho nebo více zákazníků.

Příklad 61



Investiční podnik K, OTF, s LEI OTFOTFOTFOTFOTFOTFOTFOTFOT a segmentem MIC OTFX obchoduje párováním pokynů na vlastní účet a jeho algoritmus s kódem „1234ABC“ páruje pokyn k nákupu svrchovaných dluhových nástrojů od dvou investičních podniků, Podniku X a Podniku Y, se dvěma pokyny k prodeji od dvou jiných investičních podniků, Podniku Z a Podniku L. Investiční podnik L má LEI 77777777777777777777.

Investiční podniky X a Y kupují 300 a 100 svrchovaných dluhových nástrojů a Investiční podniky Z a L prodávají 150 a 250 svrchovaných dluhových nástrojů.

Investiční podniky X, Y, Z a L jednájí v postavení na vlastní účet. Obchodník 1 učinil investiční rozhodnutí a provedl pokyn pro Investiční podnik X. Obchodník 4 učinil investiční rozhodnutí a provedl pokyn pro Investiční podnik Y. Obchodník 5 učinil investiční rozhodnutí a provedl pokyn pro Investiční podnik Z. Obchodník 9 učinil investiční rozhodnutí a provedl pokyn pro Investiční podnik L. Obchodník 9 je Patrick Down, irský státní příslušník s datem narození 14. července 1960.

Investiční podnik K spáruje pokyny dne 9. června 2018 v 16:41:07.1234Z za cenu 42,7 EUR.

Investiční podnik Z prodává na krátko s výjimkou, Investiční podnik L neprodává na krátko.

Jak hlásí Investiční podnik K (OTF)?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3	Hodnoty Hlášení č. 4
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku K
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	,INTC'	,INTC'
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	,INTC'	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku L
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'
29	Postavení	,MTCH'	,MTCH'	,MTCH'	,MTCH'
30	Množství	,300'	,100'	,150'	,250'

33	Cena	,42,7'	,42,7'	,42,7'	,42,7'
36	System	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{Kód algoritmu}	{Kód algoritmu}	{Kód algoritmu}	{Kód algoritmu}
62	Ukazatel prodeje na krátko			,SESH'	,SELL'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3	Hlášení č. 4
<pre> <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> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>	<pre> <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> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOT FOTFOTFOTFOTFOT OT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>777777777777 777777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T16:41:07.123Z</ TradDt> <TradgCpcty>MTC H</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>

<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Tr adVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</A lgo> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SEL L</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---	---	---

Protože na každé straně v tomto příkladu je zapojen více než jeden zákazník, musí se použít souhrnný účet zákazníka „INTC“, aby se spojila strana kupujícího a strana prodávajícího. Viz oddíl 5.23.

Jak hlásí zákazníci OTF provedené obchody?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3	Hodnoty Hlášení č. 4
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku L
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku K
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku K	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku L
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'	,2018-06-09T16:41:07.123Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,300'	,100'	,150'	,250'
33	Cena	,42,7'	,42,7'	,42,7'	,42,7'

36	Systém	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF	Segment {MIC} Investičního podniku K/OTF
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID } Obchodníka 5	{NATIONAL_ID } Obchodníka 9
62	Ukazatel prodeje na krátko			,SESH'	,SELL'

Znázornění XML:

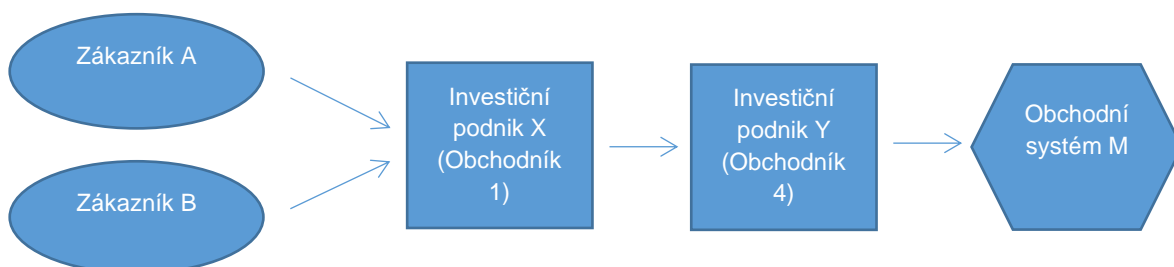
Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3	Hlášení č. 4
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPt y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGH IJKLMNOPQRST</Ex ctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>888888888 888888888888</ExctgPt y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>7777777 7777777777777</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT OTFOTFOTFOT</L EI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>777777777777 7777777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T16:41:07.123Z</ TradDt> <TradgCpcty>DEAL </TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>

<pre> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARI ECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</ Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>F11234567890A</I d> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Tr adVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id> IE19600714PATRI DOWN#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</P rtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SEL L</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---	---	--

5.25 Obchody s vyrovnávací jednotkou na základě hodnoty

K tomu může dojít, pokud investiční podniky nabízejí denní sdružené obchodování jako cenově příznivou možnost pro neprofesionální zákazníci.

Příklad 62



Dva zákazníci španělského Investičního podniku X se rozhodnou koupit stejný finanční nástroj, Zákazník A v hodnotě 400 EUR a Zákazník B v hodnotě 200 EUR. Obchodník 1 pošle sdružený pokyn v hodnotě 600 EUR Investičnímu podniku Y. Obchodník 4 provede pokyny v jednom obchodu v Obchodním systému M dne 24. června 2018 ve 14:25:30.1264 na pět jednotek nástroje za cenu 120 EUR a potvrdí provedený obchod Investičnímu podniku X. Investiční podnik X alokuje tři z těchto jednotek Zákazníkovi A v hodnotě 360 EUR a jednu jednotku Zákazníkovi B v hodnotě 120 EUR. Vyrovnávací jednotka jednoho nástroje je alokována systémem Investičního podniku X ('ALGOABC') na jeho vlastní účet se záměrem prodat ji, až to bude možné. Toto držení slouží spíše k administrativním účelům, než aby bylo myšleno jako proprietární investice.

Investiční podnik X nespĺňuje podmínky pro předání pokynu podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3	Hodnoty Hlášení č. 4
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B
12	Kupující s rozhodovací pravomocí				
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	,INTC'	,INTC'	,INTC'
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí				
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T14:25:30Z'	,2018-06-24T14:25:30Z'	,2018-06-24T14:25:30Z'	,2018-06-24T14:25:30Z'
29	Postavení	,AOTC'	,DEAL'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,5'	,1'	,3'	,1'
33	Cena	,120'	,120'	,120'	,120'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{Kód algoritmu}		
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí				

59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{Kód algoritmu}	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,ES'		,ES'	,ES'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Tržní strana	Hlášení č. 2 Strana zákazníka	Hlášení č. 3 Strana zákazníka	Hlášení č. 4 Strana zákazníka
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> <Intl>INTC</Intl> </Intl> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> </Sellr> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </LEI> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </TradgCpcty> <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> </MntryVal> </Pric> <Ccy>"EUR">120</Ccy> </Ccy> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> </TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> </MntryVal> </Pric> <Ccy>"EUR">120</Ccy> </Ccy> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </LEI> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </TradgCpcty> <Qty> <Unit>3</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> </MntryVal> </Pric> <Ccy>"EUR">120</Ccy> </Ccy> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> </MntryVal> </Pric> <Ccy>"EUR">120</Ccy> </Ccy> </MntryVal> </Pric> </pre>

<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> <InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---	---

Pole 58 a 60 v hlášení 2 jsou prázdná, protože pole 57 a 59 se vyplňují pomocí algoritmu. U hlášení 1, 3 a 4 je Investiční rozhodnutí v rámci podniku (pole 57) prázdné, protože Investiční podnik X jedná v „jakémkoli jiném postavení“; v poli 60, protože není zapojena žádná pobočka, je vyplněn kód země Investičního podniku X (ES).

Ke stejné situaci může dojít, pokud investiční podnik jedná za zákazníka na základě diskrečního pověření.

U hlášení týkajícího se vyrovnávací jednotky, protože rozhodnutí činí podnik, nikoli fyzická osoba, se v poli 57 vyplní kód algoritmu z podniku.

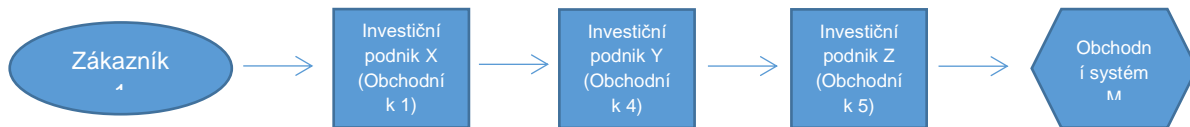
5.26 Řetězce a předávání

Tento oddíl obsahuje příklady týkající se:

- Řetězců, kdy nejsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b) (pododdíl **Error! Reference source not found.**).
- Řetězců, kdy jsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b), ale nejsou splněny všechny ostatní podmínky článku 4 (pododdíl 5.26.2).
- Řetězců, kdy dojde k předání a podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 jsou splněny všemi investičními podniky (pododdíl 5.26.3).
- Řetězců, kdy jsou podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 splněny některými investičními podniky (pododdíl 5.26.4).

Obecné vysvětlení řetězců a převodů viz příslušné oddíl **Error! Reference source not found.** v části I

Příklad 63



Zákazník 1, který je zákazníkem Investičního podniku X, se rozhodne prodat některé akcie a pověřit Investiční podnik X. Obchodník 1 se rozhodne přijmout pokyny od Zákazníka 1 a rozhodne se poslat pokyn Investičnímu podniku Y. Obchodník 4 se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku X a rozhodne se poslat pokyn Investičnímu podniku Z. Obchodník 5 v Investičním podniku Z se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku Y a algoritmus 'ALGO12345' v Investičním podniku Z vybere Obchodní systém M, do kterého zašle pokyn. Pokyn je poté dokončen v knize pokynů Obchodního systému M Investičním podnikem Z v 13:40:23.4672 dne 1. července 2018 za cenu 32,5 EUR. Obchodní systém M přidělí identifikační kód obchodů „1234“.

5.26.1 Řetězce, kdy nejsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b)

Následující příklad ukazuje, jak se vyplňují hlášení o obchodech v kontextu řetězců, kdy nejsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b), kdy každý investiční podnik nahlašuje svou bezprostřední protistranu nebo zákazníka, a také jak se u tohoto scénáře vyplňují pole 25–27 pro předání. K tomu dochází, pokud investiční podnik obchoduje na vlastní účet nebo párováním pokynů na vlastní účet. Obecné vysvětlení tohoto typu řetězce viz pododdíl 5.3.2 v části 1 těchto obecných pokynů.

Příklad 64

Investiční podniky Y a Z obchodují párováním pokynů na vlastní účet a Investiční podnik X obchoduje na vlastní účet.

Jak hlásí Investiční podniky X, Y a Z?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Z	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik X	Hodnoty hlášení č. 2 Investiční podnik X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	„1234“			
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y

16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1	{LEI} Investičního podniku X
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího				
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího				
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'
29	Postavení	,MTCH'	,MTCH'	,DEAL'	,DEAL'
33	Cena	,32,5'	,32,5'	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku			{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{Kód algoritmu}	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Z	Hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hlášení č. 1 Investičního podniku X	Hlášení č. 2 Investičního podniku X
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>888888888 888888888888</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111 1111111</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGH IJKLMNOPQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>8888888888888 8888888</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPt y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJK LMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>

<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</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> ... <TradPlcMtchgId>123 4</TradPlcMtchgId> ... </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</ Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <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> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> ... <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</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>CA111222333444 5555</Id> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <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> </pre>
---	--	--	--

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

Pole 25: Žádný z podniků nepředal pokyny, protože všechny obchodují na vlastní účet nebo párováním pokynů na vlastní účet, a proto všechny v tomto poli vyplní „false“.

Pole 26 a 27: Tato pole vyplní pouze přijímající investiční podnik, kde byly splněny podmínky pro předání. Protože to v tomto případě neplatí, nevyplní se.

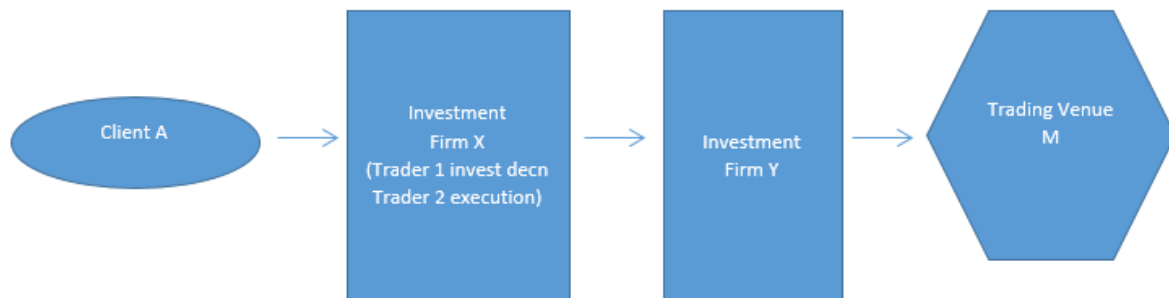
Čas a ceny u každého obchodujícího páru u stejného obchodu se musí shodovat (např. čas obchodu hlášený Investičním podnikem Z s Investičním podnikem Y bude stejný jako čas obchodu hlášený Investičním podnikem Y s Investičním podnikem Z) s výhradou odlišných požadavků na podrobnost u podniků – viz oddíl 7.2 o podrobnosti časového razítka. Podle pole 28 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 musí být pouze hlášení na tržní straně v obchodním systému předložena v souladu s požadavky na podrobnost stanovenými v článku 3 a tabulce 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574, a proto hlášení předložená podniky X a Y mohou být pouze v sekundách (ačkoli mohou být podána s vyšší podrobností). Investiční podnik X může hlásit čas provedení, který mu potvrdil Investiční podnik Y. Čas a cena, které hlásí Investiční podnik X u obchodu se Zákazníkem 1, se mohou lišit od času a ceny, které Investiční podnik X hlásí u obchodu s Investičním podnikem Y, protože k alokaci zákazníkovi u akcií může dojít v jinou dobu, než k obchodu s tržní protistranou, a může být za odlišnou cenu.

5.26.2 Řetězce, kdy jsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b), ale nejsou splněny všechny ostatní podmínky stanovené v článku 4

Následující příklady ukazují, že, s výjimkou pole 25, je hlášení u řetězců, kdy jsou splněny podmínky čl. 4 odst. 1 písm. a) a b), ale nejsou splněny všechny ostatní podmínky stanovené v článku 4, v podstatě stejné jako u řetězců, kdy nejsou splněny žádné podmínky podle článku 4.

5.26.2.1 Jednoduchý řetězec

Příklad 65



Client A	Zákazník A
Investment Firm X (Trader 1 invest decn Trader 2 execution)	Investiční podnik X (Obchodník 1 investiční rozhodnutí Obchodník 2 provedení)
Investment Firm Y	Investiční podnik Y
Trading Venue M	Obchodní systém M

Obchodník 1 učiní rozhodnutí o nákupu finančního nástroje pro Zákazníka A na základě diskrečního pověření od Zákazníka A a Obchodník 2 zadá pokyn Investičnímu podniku Y k nákupu nástroje. Investiční podnik Y, obchodující párováním pokynů na vlastní účet, provede pokyn v Obchodním systému M dne 1. června 2018 v 14:51:09.123 za cenu 32,5 EUR pomocí algoritmu s identifikačním kódem ‚ALGO12345‘.

Obchodní systém M přidělí identifikační kód obchodů ‚1234‘.

Jak hlásí Investiční podniky Y a X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení Investiční podnik X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	‚1234‘	
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Y

25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,true'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího		
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-01T14:51:09.123Z'	,2018-06-01T14:51:09Z'
29	Postavení	,MTCH'	,AOTC'
33	Cena	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{Kód algoritmu}	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku Y	Hlášení Investičního podniku X
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <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> <TradGpcty>MTCH</TradGpcty> ... </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>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-01T14:51:09Z</TradDt> <TradGpcty>AOTC</TradGpcty> </pre>

<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </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>
---	---

Investiční podnik Y nepátrá po investorovi stojícím za Investičním podnikem X a v hlášení uvede jako kupujícího Investiční podnik X. Naopak, Investiční podnik X nepátrá po systému stojícím za Investičním podnikem Y a v hlášení uvede systém jako „XOFF“.

Pole 25 je v hlášení o obchodu Investičního podniku X nastaveno na „true“, protože podnik předává pokyny, i když nespĺňuje podmínky článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Ze stejného důvodu jsou pole 26 a 27 prázdná.

Kdyby Investiční podnik X nebyl investičním podnikem, a proto by se nikdy nepoužilo předání, příslušný orgán by obdržel pouze hlášení Investičního podniku Y.

5.26.2.2 Delší řetězec

Příklad 66

Následující příklad je založen na stejném scénáři, který je popsán na začátku oddílu 5.26, s tím rozdílem, že Investiční podniky X, Y a Z jednájí v „jakémkoli jiném postavení“

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik Z	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení Investiční podnik X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Zákazníka A
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,true'	,true'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího			
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
33	Cena	,32,5'	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'

Znáznění XML:

Hlášení Investičního podniku Z	Hlášení Investičního podniku Y	Hlášení Investičního podniku X
<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123 4567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id>

<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <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> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <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> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Čas musí být u všech hlášení stejný, s výhradou rozdílných požadavků na podrobnost u podniků – viz oddíl 7.2 k podrobnosti časového razítka. Důvodem je to, že všechny podniky jednají v jakémkoli jiném postavení, a proto jsou všechna hlášení pro stejný obchod. Pouze hlášení na tržní straně v obchodním systému musí být předloženo podle článku 3 a tabulky 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574, proto stačí, aby hlášení od X a Y byla pouze v sekundách (ačkoli mohou být podána s vyšší podrobností), Investiční podnik Y může hlásit čas provedení, který mu potvrdí Investiční podnik Z, a Podnik X může hlásit čas, který mu potvrdí Investiční podnik Y.

Toto hlášení je fakticky stejné jako u řetězce, kdy investiční podniky obchodují párováním pokynů na vlastní účet, s výjimkou vyplnění pole předání ukazatele pokynů, v níž se vyplní „true“ u předávajících

podniků, které nesplňují podmínky pro předání, ale „ne“ u investičních podniků, které obchodují párováním pokynů na vlastní účet, a proto nepředávají.

Bez ohledu na to, zda je nástroj derivátovým nástrojem, se v hlášeních Investičních podniků X a Y vyplní v poli 36 „XOFF“, protože tato hlášení se netýkají přímého provedení v obchodním systému.

5.26.2.3 Řetězce včetně podniků nepodléhajících nařízení MiFIR

5.26.2.3.1 Pokyn zasláný podniku bez oznamovací povinnosti

Příklad 67

Investiční podnik učiní investiční rozhodnutí na základě diskrečního pověření o nákupu nástroje, který musí být nahlášen, pro Zákazníka A. Obchodník 1 učiní investiční rozhodnutí a Obchodník 2 se rozhodne, že zašle pokyn k provedení Podniku G, přidružené společnosti Podniku X. Investiční podnik X obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“. Podnik G je samostatnou právní osobou se sídlem v USA a s LEI GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Zákazníka A	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> y>
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí	{LEI} Investičního podniku X	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Podniku G	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id>
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		</AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr>
25	Předání ukazatele pokynů	,true'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
36	System	,XOFF'	
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2	<LEI>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG</LEI> > </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn>

			<pre> </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>
--	--	--	--

Investiční podnik X nemusí pátrat za svojí bezprostřední protistranou, proto jako prodávajícího nahlásí svoji americkou přidruženou společnost, Podnik G.

V poli 59 se vyplní vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Obchodníka 2, protože Obchodník 2 učinil rozhodnutí o zadání pokynu Podniku G.

Podnik G nehlásí obchody, protože není investičním podnikem.

5.26.2.3.2 Pokyn přijatý od podniku bez oznamovací povinnosti

Příklad 68

Podnik H je americký investiční správce s LEI HHHHHHHHHHHHHHHHHHHHH, který na základě diskrečního pověření učiní investiční rozhodnutí o nákupu nástroje, který musí být nahlášen, pro svého zákazníka, Zákazníka A. Podnik předá pokyn k provedení své přidružené společnosti, Investičnímu podniku X. Obchodník 1 jednající za Investiční podnik X provede pokyn s Investičním podnikem Z.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Podniku H	

12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Z	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		<LEI>HHHHHHHHHHHHHHHHHHHH</LEI> </Id> </AcctOwnr>
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	</Buyr> <Sellr>
36	System	,XOFF'	<AcctOwnr> <Id>
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		<LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr>
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	</Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

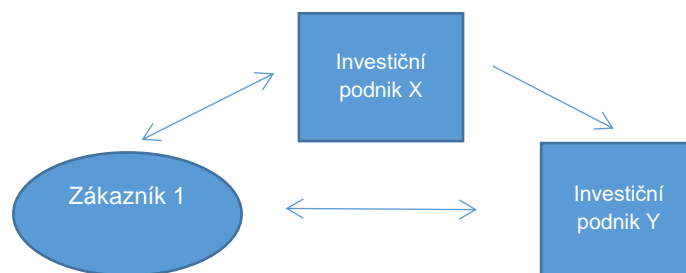
Investiční podnik X nemusí pátrat za svým bezprostředním zákazníkem a Podnik H nemůže předat při splnění podmínek článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, protože není investičním podnikem, proto Investiční podnik X nahlásí jako kupujícího americkou přidruženou společnost, Podnik H.

Podnik H nehlásí obchody, protože není investičním podnikem.

5.26.2.4 Investiční podnik X a jeho zákazník jednají na základě diskrečního pověření a jsou oba zákazníci provádějícího Investičního podniku Y.

Příklad 69

Pokud investiční správní subjekt při neexistenci předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 jedná na základě diskrečního pověření, investiční podnik přijímající pokyn nahlásí subjekt jednajícím na základě diskrečního pověření jako kupujícího/proávajícího. To platí i tehdy, když zákazník investičního správního subjektu je také zákazníkem přijímajícího investičního podniku a bez ohledu na to, zda investiční správní subjekt jednajícím na základě diskrečního pověření je investiční podnik nebo podnik.



Zákazník 1 je zákazníkem Investičního podniku Y a je také zákazníkem Investičního podniku X.

Investiční podnik X má diskreční pověření od Zákazníka 1 a učiní rozhodnutí o koupi některých finančních nástrojů pro Zákazníka 1 a zašle pokyn Investičnímu podniku Y.

Investiční podnik X nesplňuje podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Jak hlásí Investiční podnik Y pole kupující/proávající?

Investiční podnik Y hlásí jako kupujícího Investiční podnik X, nikoli Zákazníka 1.

5.26.3 Řetězce, kdy jsou podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 splněny všemi investičními podniky

Předávající investiční podnik musí předložit pouze informace stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 a pouze tehdy, pokud jsou relevantní pro daný pokyn. Například, u finančního nástroje obchodovaného na organizované obchodní platformě mimo Unii, pokud je podkladovým nástrojem finanční nástroj obchodovaný v obchodním systému, který nemá ISIN, neuvede předávající investiční podnik ISIN, protože neexistuje, a není proto pro pokyn relevantní. Dále, ačkoli předávající investiční podnik uvede informace v polích 42–56, jako by nahlašoval obchod sám, nemusí tyto informace uvádět v rámci údajů o předání poskytnutých přijímajícímu investičnímu podniku²⁹. Další informace, které má přijímající investiční podnik uvést v hlášení o obchodu, vyplní přijímající investiční podnik ze svých vlastních údajů na základě vlastního provedení. Přijímající investiční podnik použije informace od předávajícího investičního podniku pouze k nahlášení polí uvedených v příloze I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Cena a množství uvedené předávajícím investičním podnikem jsou cena a množství pokynu a skutečnou cenu a množství provedení nemusí předávající investiční podnik potvrdit, s výjimkou

²⁹ Ustanovení čl. 4 odst. 2 písm. a) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 vyžaduje, aby byl finanční nástroj identifikován pouze „identifikačním kódem“.

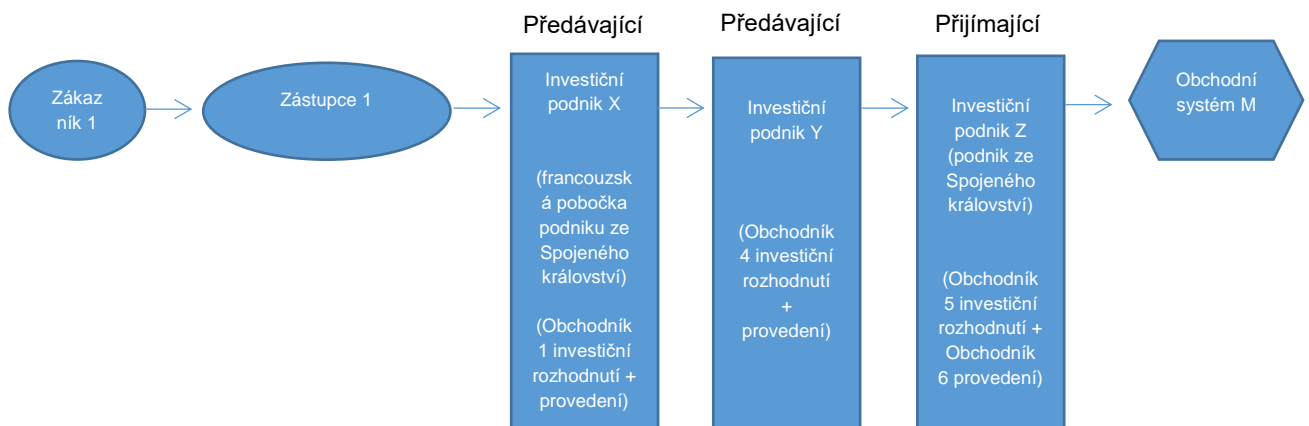
případu, kdy dojde k alokaci více než jednomu zákazníkovi, protože v tomto případě bude předávající investiční podnik muset uvést množství, která budou alokována každému zákazníkovi.

Identifikace toho, kdo je (jsou) kupující/proávající, kterého (které) přijímající investiční podnik nahlásí, závisí na tom, zda jsou splněny podmínky pro předání. Proto, pokud jsou v době pokynu uvedeny informace o alokaci zákazníkovi/zákazníkům, například pro zúčtování a vypořádání, ale neexistuje žádná dohoda o předání nebo není splněna jedna z podmínek pro předání, přijímající podnik nahlásí jako kupujícího/proávajícího investiční podnik zasílající pokyn.

Pokud jsou pole, která jsou označena jako vyplněná informacemi od předávajícího investičního podniku (zvýrazněná zeleně), v následujících příkladech prázdná, je to proto, že předávající investiční podnik je předal jako prázdná (to znamená nerelevantní).

Následující příklady uvádějí informace, které musí předávající investiční podnik poskytnout přijímajícímu investičnímu podniku, které z těchto informací musí přijímající investiční podnik nahlásit z předaných informací, nikoli ze svých vlastních informací, a jak je vyplní ve svých hlášeních. Rovněž uvádějí, že subjekt, který se má hlásit v poli Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího/proávajícího, je konečný předávající, nikoli předávající investiční podnik, který ve skutečnosti předal informace přijímajícímu investičnímu podniku.

Příklad 70



Zákazník 1 je zákazníkem Investičního podniku X. Osoba jednájící na základě oprávnění k zastupování Zákazníka 1, Zástupce 1, se rozhodne, že prodá množství 523 komoditních derivátů náležejících Zákazníkovi 1 za nejméně 31 EUR a že pověří francouzskou pobočku Investičního podniku X. Obchodník 1, který je pod dohledem sídla Podniku X ve Spojeném království, přijme pokyn od Zástupce 1 a pověří Investiční podnik Y. Obchodník 4 se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku X a zašle pokyn Investičnímu podniku Z. Investiční podnik Z je podnik ze Spojeného království. Obchodník 5 se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku Y a Obchodník 6 zašle pokyn do Obchodního systému M.

Pokyn je částečně proveden v knize pokynů Obchodního systému M ve 13:40:23.4672 dne 1. července 2018 na 500 finančních nástrojů za cenu 32,50 EUR. Obchodní systém přidělí identifikační kód obchodu „1234“.

Komoditní derivát má ISIN XX000000001.

Zákazník 1 snižuje riziko objektivně měřitelným způsobem v souladu s článkem 57 směrnice 2014/65/EU.

Investiční podniky X a Y oba splňují všechny podmínky pro předání.

Investiční podnik X poskytne Investičnímu podniku Y:

- 1) Identifikační kód finančního nástroje: ISIN pro finanční nástroj (XX000000001)
- 2) Skutečnost, že pokyn spočívá v pozbytí finančního nástroje
- 3) Cenu a množství pokynu: 523 finančních nástrojů za nejméně 31 EUR
- 4) Označení prodávajícího: vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Zákazníka 1
- 5) Údaje o Zákazníkovi 1
 - a) Jméno a příjmení
 - b) Datum narození
- 6) Označení a údaje o subjektu s rozhodovací pravomocí: vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Zástupce 1, jméno, příjmení a datum narození Zástupce 1.
- 7) Označení k identifikaci osoby nebo algoritmu odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci předávajícího podniku (Investičního podniku X): prázdné (protože investiční rozhodnutí je učiněno mimo podnik – rozhodnutí učinil Zástupce 1).
- 8) Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí: prázdné
- 9) Země pobočky Investičního podniku X, která přijala pokyn od zákazníka: FR
- 10) Ukazatel komoditního derivátu: ano
- 11) Kód identifikující předávající investiční podnik: LEI Investičního podniku X

Protože Investiční podnik Y také předává, poskytne Investičnímu podniku Z stejné informace, jako poskytl Investiční podnik X jemu, včetně kódu identifikujícího předávající investiční podnik, což v tomto případě je LEI Investičního podniku X.

V poli 27 se vyplní Investiční podnik X, protože Investiční podnik X v konečném důsledku informace předal a tyto informace byly předány Investičním podnikem Y Investičnímu podniku Z.

U bodů 1 a 4–10 uvedených výše jsou informace stejné jako ty, které by hlásil Investiční podnik X, kdyby nesplňoval podmínky pro předání a kdyby zasílal svoje vlastní hlášení o obchodu.

U následujících příkladů se pole zvýrazněná zeleně v hlášení Investičního podniku Z vyplňují přímo z informací poskytnutých předávajícím investičním podnikem, Investičním podnikem Y.

Protože Investiční podniky X i Y splňují podmínky pro předání, nemusí hlásit obchody.

5.26.3.1 Přijímající investiční podnik obchoduje na vlastní účet

Hlášení Investičního podniku Z bude následující:

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'	
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Z
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Z
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Z	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1
17	Země pobočky u prodávajícího		,FR'
18	Jméno (jména) prodávajícího		,JEAN'
19	Příjmení prodávajícího		,COCTEAU'
20	Prodávající – datum narození		1962-06-04
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		{NATIONAL_ID} pro Zástupce 1
22	Subjekt rozhodující o prodeji – jméno (jména)		,FABIO'
23	Subjekt rozhodující o prodeji – příjmení		,LUCA'
24	Subjekt rozhodující o prodeji – datum narození		,1962-10-11'
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího		
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,500'	,500'
33	Cena	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	{ISIN} nástroje
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 5	

58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	,GB'	
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,GB'	,GB'
64	Ukazatel komoditního derivátu	,false'	,true'

Znárodnění XML:

Hlášení č. 1 na tržní straně	Hlášení č. 2 na straně zákazníka
<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> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglD>1234</TradPlcMtchglD> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> </Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</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> </pre>

<pre> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>F11234567890A</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> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <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> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---

Pole 57: protože Investiční podnik Z obchoduje na vlastní účet, činí investiční rozhodnutí a osoba, která činí rozhodnutí v rámci Investičního podniku Z (Obchodník 5) se vyplní v hlášení na tržní straně v poli 57. Hlášení na straně zákazníka se vyplní z informací přijatých od předávajícího investičního podniku. V tomto příkladu bude pole prázdné, protože tyto informace byly přijaty od Investičního podniku X jako prázdné (protože rozhodnutí učinil Zástupce 1).

Pole 58: Ačkoli pokyn vychází z pobočky, rozhodnutí učinil zákazník (nebo jeho zástupce), a proto je pole v hlášení na straně zákazníka prázdné.

Čas a cena se shodují (s výhradou odlišných požadavků na podrobnost), ale čas u hlášení na straně zákazníka by mohl být pozdější, aby odrazil čas, kdy se zákazník stal vlastníkem. Pouze hlášení na tržní straně od Investičního podniku Z musí být předloženo s podrobností na mikrosekundy. Hlášení na straně zákazníka může být předloženo pouze v sekundách (ačkoli Investiční podnik Z může hlásit s vyšší podrobností).

5.26.3.2 Přijímající podnik obchodující „párováním pokynů na vlastní účet / v jakémkoli jiném postavení“

Příklad 71

Pokud přijímající investiční podnik, Podnik Z, obchoduje párováním pokynů na vlastní účet, hlásí obchody takto:

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'	<Tx> <New>
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	... <ExctgPty>88888888888888888888888888888888</ExctgPty>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	... <Buyr> <AcctOwnc> <Id>
16	Identifikační kód prodávajícího	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1	<LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id>
17	Země pobočky u prodávajícího	,FR'	</AcctOwnc> </Buyr>
18	Jméno (jména) prodávajícího	,JEAN'	<Sellr> <AcctOwnc> <Id>
19	Příjmení prodávajícího	,COCTEAU'	<Prsn>
20	Prodávající – datum narození	,1962-06-04'	<FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm>
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí	{NATIONAL_ID} Zástupce 1	<BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr>
22	Subjekt rozhodující o prodeji – jméno (jména)	,FABIO'	<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm>
23	Subjekt rozhodující o prodeji – příjmení	,LUCA'	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm>
24	Subjekt rozhodující o prodeji – datum narození	,1974-10-11'	</Othr> </Prsn>
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	</Id> <CtryOfBrnc>FR</CtryOfBrnc>
26	Identifikační kód prodávajícího podniku pro kupujícího		</AcctOwnc> <DcsnMakr> <Prsn>

27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</ TrnsmtgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <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> ... <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </pre>
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	
29	Postavení	,MTCH'	
30	Množství	,500'	
33	Cena	,32,5'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí		
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	
64	Ukazatel komoditního derivátu	,true'	

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

Pokud Investiční podnik Z jedná v „jakémkoli jiném postavení“, hlášení o obchodu bude stejné jako hlášení uvedené výše, pouze postavení v poli 29 bude hlášeno jako „AOTC“.

5.26.3.3 Zákazník má oznamovací povinnost

Příklad 72

Předpokládejme, že místo Zákazníka 1 je Zákazník A a že je investičním podnikem. Zákazník A hlásí cenu a čas, které mu potvrdí Investiční podnik X. Pokud předpokládáme, že Investiční podnik Z jedná v „jakémkoli jiném postavení“ nebo „párováním pokynů na vlastní účet“, Zákazník A předkládá hlášení o obchodu se stejnou cenou a časem jako v hlášení Investičního podniku Z, s výhradou požadavků na podrobnost, jak uvádí oddíl 7.2, protože Investiční podniky X, Y a Z všechny jednají v „jakémkoli jiném postavení“, a proto je toto celé jeden obchod. Pokud Investiční podnik Z jedná na vlastní účet, cena a čas se mohou lišit. Zákazník A identifikuje Investiční podnik X jako kupujícího, protože s ním Zákazník A obchoduje.

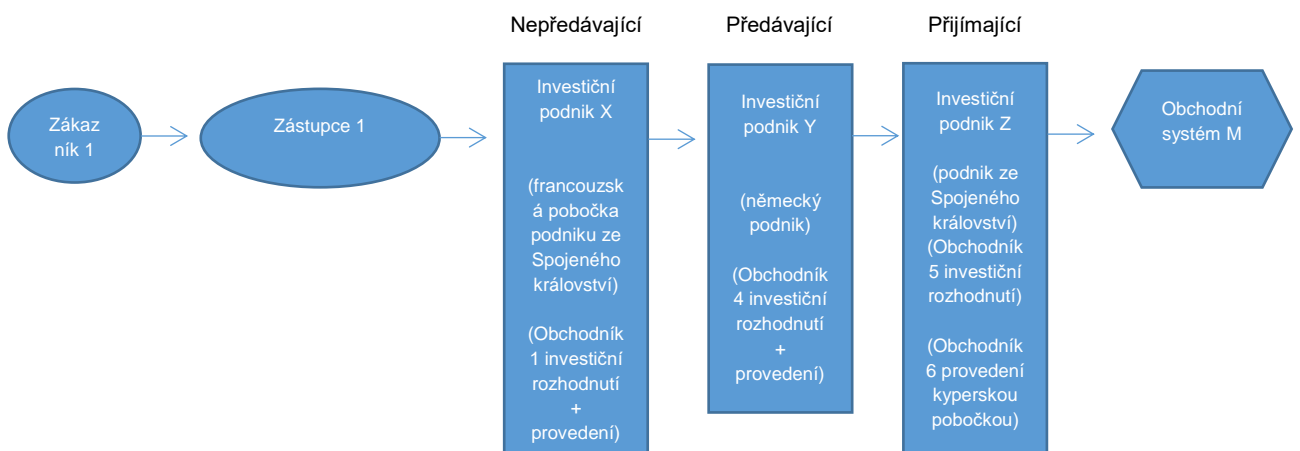
Hlášení Investičního podniku Z je stejné jako v příkladech v 5.26.3.2 (podle jeho postavení) s tím rozdílem, že Zákazníka A identifikuje pomocí LEI Zákazníka A a Ukazatel komoditního derivátu bude vyplněn 'false'.

5.26.4 Řetězce, kdy jsou podmínky stanovené v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 splněny některými investičními podniky v řetězci

Následující příklad ukazuje, že předávající investiční podnik musí uvést, zda je on sám nebo jiná strana původním předávajícím investičním podnikem.

5.26.4.1 Investiční podnik obchodující s konečným zákazníkem nesplňuje podmínky pro předání

Příklad 73



Zákazník 1 je zákazníkem Investičního podniku X. Osoba jednající na základě oprávnění k zastupování Zákazníka 1, Zástupce 1, se rozhodne prodat některé akcie Zákazníka 1 a pověří francouzskou pobočku Investičního podniku X. Obchodník 1, který je pod dohledem sídla ve Spojeném království, se rozhodne přijmout pokyn od Zákazníka 1 a rozhodne se, že zašle pokyn Investičnímu podniku Y, německému podniku. Obchodník 4 se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku Y a zašle ho Investičnímu podniku Z. Obchodník 5 se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku Y a Obchodník 6 pod dohledem kyperské pobočky Investičního podniku Z zašle pokyn do Obchodního systému M. Investiční podnik X a Podnik Y jednají v „jakémkoli jiném postavení“, zatímco Investiční podnik Z jedná na vlastní účet.

Pokyn je splněn v knize pokynů Obchodního systému M Investičním podnikem Z v 13:40:23.4672 dne 1. července 2018 za cenu 32,50 EUR. Obchodní systém přidělí identifikační kód obchodu „1234“. Investiční podnik X se rozhodne nepředávat údaje Investičnímu podniku Y.

Investiční podnik Y předá údaje o svém zákazníkovi (Investičním podniku X) a další požadované informace Investičnímu podniku Z a splňuje ostatní podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Investiční podnik Y je německý podnik.

Zákazník 1 prodává na krátko.

Předmětem obchodu je akcie s ISIN XX000000002.

Investiční podnik Y poskytne Investičnímu podniku Z:

- 1) Identifikační kód finančního nástroje: ISIN pro nástroj XX000000002
- 2) Skutečnost, že pokyn spočívá v pozbytí finančního nástroje
- 3) Cenu a množství pokynu
- 4) Označení prodávajícího: LEI Investičního podniku X. Důvodem je to, že Investiční podnik X nepředal údaje o svém zákazníkovi (Zákazníkovi 1) Investičnímu podniku Y. Proto bude Investiční podnik Y považovat za prodávajícího Investiční podnik X, nikoli Zákazníka 1.
- 5) Označení a údaje o subjektu s rozhodovací pravomocí: prázdné
- 6) Ukazatel prodeje na krátko: SELL (Investiční podnik X neprodává na krátko)
- 7) Označení k identifikaci osoby nebo algoritmu odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci předávajícího podniku: prázdné (protože rozhodnutí je učiněno mimo podnik).
- 8) Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí: prázdné (protože rozhodnutí je učiněno mimo Investiční podnik Y).
- 9) Země pobočky Investičního podniku Y, která přijala pokyn od zákazníka: DE (protože nebyla zapojena žádná pobočka, vyplní se zde 2písmenný kód země sídla podniku, v tomto případě jde o německý podnik, proto se do tohoto pole vyplní „DE“).

10) Kód identifikující předávající investiční podnik: LEI Investičního podniku Y

Protože Investiční podnik X nespĺňuje podmínky pro předání, zašle své vlastní hlášení o obchodu.

Protože Investiční podnik Y splňuje podmínky pro předání, nezasílá hlášení o obchodu.

Jak hlásí Investiční podniky X a Z?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investičního podniku Z	Hodnoty hlášení č. 2 Investičního podniku Z	Hodnoty hlášení Investičního podniku X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku X	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1
17	Země pobočky u prodávajícího		,DE'	,FR'
18	Jméno (jména) prodávajícího			,JEAN'
19	Příjmení prodávajícího			,COCTEAU'
20	Prodávající – datum narození			,1962-06-04'
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí			{NATIONAL_ID} Zástupce 1
22	Subjekt rozhodující o prodeji – jméno (jména)			,FABIO'
23	Subjekt rozhodující o prodeji – příjmení			,LUCA'
24	Subjekt rozhodující o prodeji – datum narození			,1974-10-11'
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,true'
26	Identifikační kód prodávajícího			

	podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		{LEI} Investičního podniku Y	
28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,AOTC'
33	Cena	,32,5'	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	System	Segment {MIC} Obchodního systému M	XOFF	XOFF
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	{ISIN} nástroje	{ISIN} nástroje
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 5		
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	,GB'		
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,CY'	,CY'	,GB'
62	Ukazatel prodeje na krátko	,SELL'	,SELL'	,SESH'

Znárodnění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Z Tržní strana	Hlášení č. 2 Investičního podniku Z Strana zákazníka	Hlášení č. 1 Investičního podniku X
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888 888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </pre>

<pre> <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> <TradPlcMtchGld>1234</TradPlcMtchGld> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> </pre>	<pre> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</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> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> </Othr> <SchmeNm> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTEAU</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> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </pre>
---	---	--

<pre> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JO NES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> ... <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> </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> </pre>
--	---	---

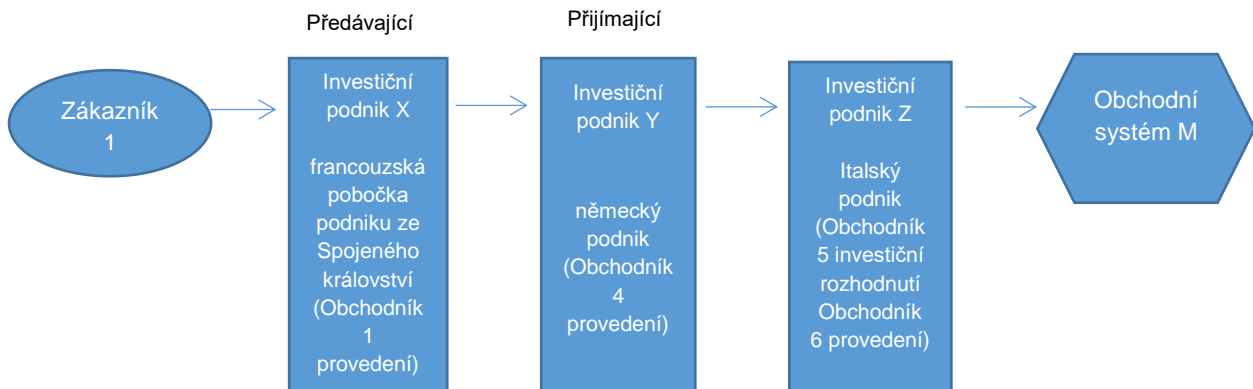
„Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího“ (pole 27) pro prodávajícího v hlášeních o obchodech Investičního podniku Z patří Investičnímu podniku Y, nikoli Investičnímu podniku X (protože Investiční podnik X nepředával), protože Investiční podnik Y uvedl Investičnímu podniku Z, že pokyn, který zasílá Investičnímu podniku Z, předává sám na účet Investičního podniku X.

V polích 57 a 58 hlášení 2 (hlášení na straně zákazníka) jsou vyplněny informace poskytnuté Investičním podnikem Y Investičnímu podniku Z, který hlásí obchody. Obě pole jsou prázdná, protože rozhodnutí učinil zákazník. Naopak, pole 59 a 60 musí vyplnit Investiční podnik Z vlastními informacemi, a proto je vyplněn Obchodník 6, který je pod dohledem kyperské pobočky Investičního podniku Z³⁰.

5.26.4.2 Investiční podnik jednající jako přijímající podnik i předávající podnik bez splnění podmínek pro předání

³⁰ Ačkoli upozorňujeme, že kdyby rozhodnutí učinil zákazník, vyplnilo by se ‚NORE‘ (viz oddíl 5.12).

Příklad 74



Zákazník 1 je zákazníkem Investičního podniku X. Obchodník 1, který se nachází ve francouzské pobočce Investičního podniku X a jedná na základě diskrečního pověření poskytnutého Zákazníkem 1, dá Investičnímu podniku Y, německému podniku, pokyn k prodeji finančních nástrojů. Obchodník 1 je pod dohledem sídla Investičního podniku X ve Spojeném království. Obchodník 4 se rozhodne přijmout pokyn od Podniku X a rozhodne se zaslat pokyn Podniku Z. Obchodník 5 jednající za Investiční podnik Z, italský podnik, se rozhodne přijmout pokyn od Investičního podniku Y a Obchodník 6 zašle pokyn do Obchodního systému M.

Pokyn je poté dokončen v knize pokynů Obchodního systému M Investičním podnikem Z ve 13:40:23.4672 dne 1. července 2018 za cenu 32,50 EUR. Obchodní systém přidělí identifikační kód obchodu „1234“.

Investiční podnik X předá údaje o Zákazníkovi 1 a další informace Investičnímu podniku Y a splňuje další podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Investiční podnik Y se rozhodne nepředávat údaje Investičnímu podniku Z. Investiční podnik Z jedná na vlastní účet.

Předmětem obchodu je komoditní derivát s ISIN XX000000003 a Zákazník 1 nesnižuje riziko objektivně měřitelným způsobem podle článku 57 směrnice 2014/65/EU.

Investiční podnik X poskytne Investičnímu podniku Y:

- 1) Identifikační kód nástroje: ISIN pro nástroj (XX000000003)
- 2) Skutečnost, že pokyn spočívá v pozbytí finančního nástroje
- 3) Cenu a množství pokynu
- 4) Označení prodávajícího: vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Zákazníka 1
- 5) Údaje o Zákazníkovi 1
 - a) Jméno (jména) a příjmení
 - b) Datum narození
- 6) Označení a údaje o subjektu s rozhodovací pravomocí: LEI pro Investiční podnik X
- 7) Označení k identifikaci osoby nebo algoritmu odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci předávajícího podniku (Investičního podniku X): {NATIONAL_ID} Obchodníka 1
- 8) Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí: GB
- 9) Země pobočky Investičního podniku X, která přijala pokyn od zákazníka: FR
- 10) Kód identifikující předávající podnik: LEI Investičního podniku X
- 11) Ukazatel komoditního derivátu: ne

Protože Investiční podnik Y nepředává všechny údaje, zasílá své vlastní hlášení o obchodu.
Protože Investiční podnik X splňuje podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nehlásí obchody.

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investičního podniku Z	Hodnoty hlášení č. 2 Investičního podniku Z	Hodnoty hlášení č. 1 Investičního podniku Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Z
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Z	{LEI} Investičního podniku Y	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1
17	Země pobočky u prodávajícího		,IT'	,FR'
18	Jméno (jména) prodávajícího			,JEAN'
19	Příjmení prodávajícího			,COCTEAU'
20	Prodávající – datum narození			,1962-06-04'
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí			{LEI} Investičního podniku X
22	Subjekt rozhodující o prodeji – jméno (jména)			
23	Subjekt rozhodující o prodeji – příjmení			
24	Subjekt rozhodující o prodeji – datum narození			
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,true'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího			LEI Investičního podniku X

28	Datum a čas obchodování	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23.467Z'	,2018-07-01T13:40:23Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,AOTC'
33	Cena	,32,5'	,32,5'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	{Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	{ISIN} nástroje	{ISIN} nástroje
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 5	{NATIONAL_ID} Obchodníka 5	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	,IT'	,IT'	,GB'
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	{NATIONAL_ID} Obchodníka 6	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,IT'	,IT'	,DE'
64	Ukazatel komoditního derivátu	,false'	,false'	,false'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Z Tržní strana	Hlášení č. 2 Investičního podniku Z Strana zákazníka	Hlášení č. 1 Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> </pre>

<pre> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwNr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCp cty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchglD>1234</Trad PlcMchglD> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</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> </pre>	<pre> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQP QRST</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > </AcctOwNr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCp cty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</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> </pre>	<pre> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCT E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnc h> </AcctOwNr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</Trnsmssn Ind> <TrnsmtgSellr>123456789012 34567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc h> <Othr> </pre>
--	---	---

<pre> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <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>
---	---	--

Investiční podnik Y jedná jako přijímající investiční podnik (přijímá informace od Investičního podniku X, kdy jsou splněny podmínky pro předání) a také jedná jako předávající investiční podnik, který nesplňuje podmínky pro předání. Z toho důvodu musí Investiční podnik Y hlásit obchody. Investiční podnik Y vyplní pole 25, aby uvedl, že předává bez splnění podmínek pro předání, a pole 27, aby uvedl, že přijal informace od Investičního podniku X, který splnil podmínky pro předání Investičnímu podniku Y. Také v poli 17 se vyplní informace přijaté od Investičního podniku X, a bude zde proto uvedena pobočka předávajícího investičního podniku, nikoli pobočka přijímajícího investičního podniku.

5.26.4.3 Podnik provádí sdružení a splňuje podmínky pro předání u některých pokynů a u jiných ne

Příklad 75

Dva zákazníci Investičního podniku X, Zákazník A a Zákazník B, zadají pokyny k prodeji na 100 a 200 nástrojů.

Investiční podnik X předává pokyny Investičnímu podniku Y. Investiční podnik X splňuje podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 pouze pro pokyn Zákazníka A. Investiční podnik Y provádí sdružený pokyn na 300 za 25,54 EUR dne 28. října 2018

v 11:23:45.1243 v Obchodním systému M. Investiční podnik X a podnik Y obchodují v „jakémkoli jiném postavení“.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znárodnění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Zákazníka B	
25	Předání ukazatele pokynů	,true‘	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr>
28	Datum a čas obchodování	,2018-10-28T11:23:45Z‘	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr>
29	Postavení	,AOTC‘	<Id>
30	Množství	,200‘	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id>
33	Cena	,25,54‘	</AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn>
36	System	,XOFF‘	<Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

Jak hlásí Investiční podnik Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2	Hodnoty hlášení č. 3
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	,INTC'	,INTC'
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Investičního podniku X
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		{LEI} Investičního podniku X	
28	Datum a čas obchodování	,2018-10-28T11:23:45.124Z'	,2018-10-28T11:23:45.124Z'	,2018-10-28T11:23:45.124Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,300'	,100'	,200'
33	Cena	,25,54'	,25,54'	,25,54'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'

Znázornění XML:

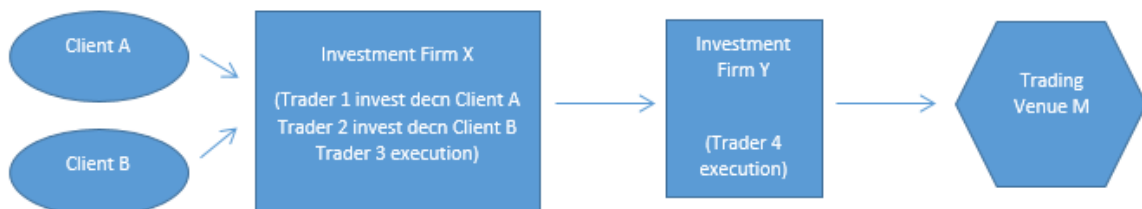
Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> </pre>

<pre> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <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> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </pre>
---	---	---

5.27 Investiční podnik jednající na základě diskrečního pověření za více zákazníků

5.27.1 Investiční podnik jednající na základě diskrečního pověření za více zákazníků bez splnění podmínek pro předání (kombinace sdružených pokynů a řetězců/předání)

Příklad 76



Client A	Zákazník A
Client B	Zákazník B

Investment Firm X	Investiční podnik X
(Trader 1 invest decn Client A Trader 1 invest decn Client B Trader 3 execution)	(Obchodník 1 investiční rozhodnutí Zákazník A Obchodník 1 investiční rozhodnutí Zákazník B Obchodník 3 provedení)
Investment Firm Y	Investiční podnik Y
(Trader 3 execution)	(Obchodník 3 provedení)
Trading Venue M	Obchodní systém M

Investiční podnik X jedná za Zákazníka A a Zákazníka B na základě diskrečních pověření. Obchodník 1 se rozhodne koupit 400 jednotek daného finančního nástroje pro Zákazníka A. Obchodník 2 se rozhodne koupit 200 jednotek téhož finančního nástroje pro Zákazníka B. Obchodník 3 pošle sdružený pokyn k provedení Investičnímu podniku Y. Pokyn je poté proveden v Obchodním systému M Obchodníkem 4 ve dvou obchodech, jednom 24. června 2018 v 14:25:30.1264 na 350 nástrojů za 30 EUR a jednom dne 24. června 2018 v 15:55:40.3452 na 250 nástrojů za 32,5 EUR. Obchodní systém poskytne pro obchody identifikační kódy obchodu „1234“ a „6789“.

Kdyby místo Investičního podniku X byla společnost pro správu fondů spravující fond a nejednalo se o investiční podnik, společnost pro správu fondů by byla identifikována Investičním podnikem Y jako kupující/prodávající a pole pro subjekt s rozhodovací pravomocí by se nevyplnila, protože společnost pro správu fondů není investiční podnik, nemá tedy oznamovací povinnost a nemůže předávat.

To, jak Investiční podnik X hlásí, závisí na tom, jak Investiční podnik Y potvrdí provedení Investičnímu podniku X, jak je ukázáno níže.

Podobně to, jak by hlásili Zákazník A a Zákazník B, kdyby byli investičními podniky, závisí na tom, jak by jim provedení potvrdil Investiční podnik X.

Investiční podnik X nesplňuje podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Investiční podnik X jedná v „jakémkoli jiném postavení“.

5.27.1.1 Investiční podnik Y potvrzuje Investičnímu podniku X každé z provedení na tržní straně

K tomu by mělo dojít, pokud by makléř provádějící pokyny jednal v „jakémkoli jiném postavení“ nebo párováním pokynů na vlastní účet.

Investiční podnik Y jedná v „jakémkoli jiném postavení“.

Příklad 77

Scénář stanovený v příkladu v 5.27.1, kdy makléř provádějící pokyn Y potvrzuje provedení na trhu Investičnímu podniku X.

Investiční podnik X musí předložit hlášení, protože nesplňuje podmínky pro předání.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1 Investiční ho podniku X	Hodnoty Hlášení č. 2 Investiční ho podniku X	Hodnoty Hlášení č. 3 Investiční ho podniku X	Hodnoty Hlášení č. 4 Investiční ho podniku X	Hodnoty Hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty Hlášení č. 2 Investiční podnik Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému					,1234'	,6789'
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	,INTC'	{LEI} Zákazník a A	{LEI} Zákazník a B	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí			{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X		
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku Y	,INTC'	,INTC'	{LEI} ústřední protistran y pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistran y pro Obchodní systém M
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí						
25	Předání ukazatele pokynů	,true'	,true'	,true'	,true'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího						
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího						

28	Datum a čas obchodování	,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	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,350'	,250'	,400'	,200'	,350'	,250'
33	Cena	,30'	,32,5'	,31,0416667'	,31,0416667'	,30'	,32,5'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'	Segment {MIC} Obchodního systému	Segment {MIC} Obchodního systému
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku			{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2		
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 3	{NATIONAL_ID} Obchodníka 3	{NATIONAL_ID} Obchodníka 3	{NATIONAL_ID} Obchodníka 3	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4

Upozorňujeme, že v hlášeních 3 a 4 Investičního podniku X pole 12 identifikuje Investiční podnik X, protože Investiční podnik X jedná na základě diskrečního pověření za zákazníky A a B. Identita obchodníků, kteří učinili rozhodnutí za zákazníky A a B, se vyplní v poli 57.

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku X	Hlášení č. 2 Investičního podniku X	Hlášení č. 3 Investičního podniku X	Hlášení č. 4 Investičního podniku X
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <DcsnMakr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <DcsnMakr> </pre>

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

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

Hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hlášení č. 2 Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <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>2018-06-24T14:25:30.126Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</Exc tgPty> ... <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>2018-06-24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>

<pre> <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> <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>
--	--

Kromě alokací zákazníkům hlásí Investiční podnik X obchod „na tržní straně“ s Investičním podnikem Y.

Investiční podnik X hlásí každý obchod, který mu potvrdí Investiční podnik Y, do souhrnného účtu zákazníka „INTC“ a poté hlásí pohyb ze souhrnného účtu k zákazníkům.

Pokud Investiční podnik Y jednal párováním pokynů na vlastní účet, hlášení bude stejné, jen postavení v hlášeních Investičního podniku Y bude vyplněno v poli 29 jako „MTCH“.

5.27.1.2 Investiční podnik Y potvrdí dokončený obchod Investičnímu podniku X

K tomu dojde, pokud makléř provádějící pokyny Y jedná v postavení na vlastní účet.

Příklad 78

Scénář je stejný jako v příkladu v 5.27.1 uvedeném výše, ale Investiční podnik Y potvrzuje Investičnímu podniku X dokončený obchod, nikoli jednotlivá provedení na trhu. Čas je časem druhého provedení nebo pozdější, aby odrazil čas, kdy došlo k alokaci Investičnímu podniku Y. Například Y potvrzuje Investičnímu podniku X, že koupil 600 akcií za cenu 31,0416667 dne 2018-06-24 v 16:06:20.34.

Investiční podnik X musí předložit hlášení, protože nesplňuje podmínky pro předání.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1 Investiční podnik X	Hodnoty Hlášení č. 2 Investiční podnik X	Hodnoty Hlášení č. 3 Investiční podnik X	Hodnoty Hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty Hlášení č. 2 Investiční podnik Y	Hodnoty Hlášení č. 3 Investiční podnik Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému				,1234'	,6789'	
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	{LEI} Zákazník a A	{LEI} Zákazník a B	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku Y	{LEI} Investiční ho podniku X
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		{LEI} Investiční ho podniku X	{LEI} Investiční ho podniku X			
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investiční ho podniku Y	,INTC'	,INTC'	{LEI} ústřední protistran y pro Obchodní systém M	{LEI} ústřední protistran y pro Obchodní systém M	{LEI} Investiční ho podniku Y
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí						
25	Předání ukazatele pokynů	,true'	,true'	,true'	,false'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího						
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího						
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T16:06:20Z'	,2018-06-24T16:06:20Z'	,2018-06-24T16:06:20Z'	,2018-06-24T14:25:30.126.Z'	,2018-06-24T15:55:40.345Z'	,2018-06-24T16:06:20Z'

29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,600'	,400'	,200'	,350'	,250'	,600'
33	Cena	,31,04166 67'	,31,04166 67'	,31,04166 67'	,30'	,32,5'	,31,04166 67'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	System	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'	Segment {MIC} Obchodní ho systému M	Segment {MIC} Obchodní ho systému M	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{NATION AL_ID} Obchodní ka 1	{NATION AL_ID} Obchodní ka 2	{NATION AL_ID} Obchodní ka 4	{NATION AL_ID} Obchodní ka 4	{NATIONA L_ID} Obchodník a 4
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATION AL_ID} Obchodní ka 3	{NATION AL_ID} Obchodní ka 3	{NATION AL_ID} Obchodní ka 3	{NATION AL_ID} Obchodní ka 4	{NATION AL_ID} Obchodní ka 4	{NATIONA L_ID} Obchodník a 4

Znárodnění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku X	Hlášení č. 2 Investičního podniku X	Hlášení č. 3 Investičního podniku X
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQP RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </pre>

<pre> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> </Othr> </ExctgPrsn> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> </Othr> </InvstmtDcsnPrsn> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> </Othr> </ExctgPrsn> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:06:20Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> </Othr> </InvstmtDcsnPrsn> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> </Othr> </ExctgPrsn> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hlášení č. 2 Investičního podniku Y	Hlášení č. 3 Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:30.126.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPI cMtchgId> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>6789</TradPI cMtchgId> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO P QRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> </pre>

<pre> ... <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> </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> <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>
---	---	---

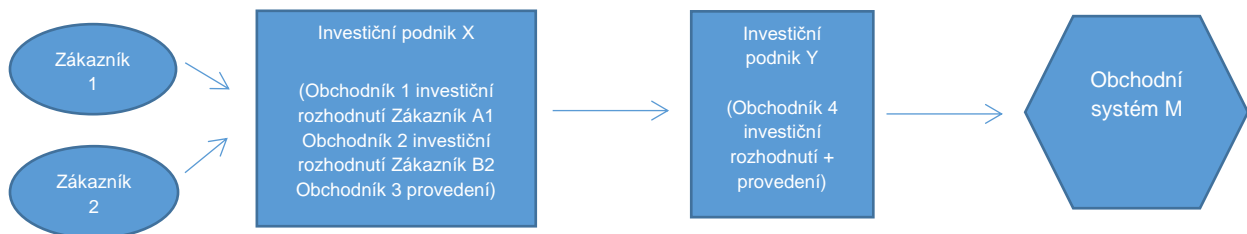
Stejně jak je uvedeno výše, Investiční podnik X kromě alokace zákazníkům hlásí obchod „na tržní straně“ u Investičního podniku Y.

Protože Investiční podnik Y obchoduje na vlastní účet, potvrzuje dokončené souhrnné množství podniku X, takže Investiční podnik X hlásí obchod pro souhrnné množství na souhrnný účet zákazníka „INTC“ a poté hlásí pohyb z tohoto účtu k zákazníkům.

Pokud Investiční podnik X sdružuje pokyny a splňuje podmínky pro předání pouze u některých pokynů a u jiných ne, viz oddíl 5.26.4.3.

5.27.2 Investiční správce, který jedná na základě diskrečního pověření za více zákazníků a splňuje podmínky pro předání

Příklad 79



Obchodník 1 pod dohledem Investičního podniku X, podniku jednajícího na základě diskrečního pověření za zákazníky 1 a 2, se rozhodne prodat 500 akcií za Zákazníka 1 a Obchodník 2 pod dohledem Investičního podniku X se rozhodne prodat 200 akcií za Zákazníka 2. Obchodník 3 pod dohledem Investičního podniku X pošle sdružený pokyn na 700 akcií Investičnímu podniku Y. Obchodník 4 pod dohledem Investičního podniku Y přijme pokyn a provede jej v Obchodním systému M v jednom provedení dne 24. června 2018 v 13:20:52.1456 za cenu 21 EUR.

Investiční podnik X je podnik ze Spojeného království a Investiční podnik Y je italský podnik.

Zákazník 1 prodává na krátko, Zákazník 2 ne. Investiční podnik Y byl neutrální před prodejem na trhu, a proto prodává na krátko v čase provedení na trhu.

Investiční podnik X předává údaje o Zákazníkovi 1 a Zákazníkovi 2 a další informace Investičnímu podniku Y, jak je uvedeno níže, a splňuje ostatní podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Investiční podnik X poskytne Investičnímu podniku Y:

- 1) Identifikační kód finančního nástroje: ISIN pro nástroj
- 2) Skutečnost, že pokyn spočívá v pozbytí finančního nástroje
- 3) Cenu a množství pokynu: tržní cenu za 700 akcií
- 4) Označení a údaje o subjektu s rozhodovací pravomocí: LEI Investičního podniku X
- 5) Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí: GB
- 6) Země pobočky Investičního podniku X, která učinila investiční rozhodnutí: GB
- 7) Kód identifikující předávající podnik: LEI Investičního podniku X

Investiční podnik X následně zajistí (po provedení, ale v době, která je povolena na základě dohody o předání):

- 8) Alokace Zákazníkovi 1 a Zákazníkovi 2

- 9) Označení prodávajících: vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Zákazníka 1 a vnitrostátní identifikační kód zákazníka pro Zákazníka 2
- 10) Údaje o Zákazníkovi 1
- Jméno (jména) a příjmení
 - Datum narození
- 11) Ukazatel prodeje na krátko pro Zákazníka 1: SESH (Zákazník 1 prodává na krátko)
- 12) Označení k identifikaci osoby nebo algoritmu odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci podniku pro Zákazníka 1: {NATIONAL_ID} Obchodníka 1
- 13) Údaje o Zákazníkovi 2
- Jméno (jména) a příjmení
 - Datum narození
- 14) Ukazatel prodeje na krátko pro Zákazníka 2: SELL (Zákazník 2 neprodává na krátko)
- 15) Označení k identifikaci osoby nebo algoritmu odpovědného za investiční rozhodnutí v rámci podniku pro Zákazníka 2: {NATIONAL_ID} Obchodníka 2

Investiční podnik Y jedná na vlastní účet a převádí cenné papíry Investičnímu podniku X v 15:00:12:51 téhož dne.

Jak hlásí Investiční podnik Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 2 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 3 Investiční podnik Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234‘		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí			
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1	{NATIONAL_ID} Zákazníka 2

18	Jméno (jména) prodávajícího		,JEAN'	,JOSE, LUIS'
19	Příjmení prodávajícího		,COCTEAU'	,RODRIGUEZ, DE LA TORRE'
20	Prodávající – datum narození		,1962-06-04'	,1976-02-27'
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		{LEI} Podniku X	{LEI} Podniku X
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T13:20:52.1456Z'	,2018-06-24T15:00:12Z'	,2018-06-24T15:00:12Z'
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
30	Množství	,700'	,500'	,200'
33	Cena	,21'	,21'	,21'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí	,IT'	,GB'	,GB'
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,IT'	,IT'	,IT'
62	Ukazatel prodeje na krátko	,SESH'	,SESH'	,SELL'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1

Hlášení č. 2

Hlášení č. 3

Investičního podniku Y	Investičního podniku Y	Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQ 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> <TradPlcMtchgId>1234</TradPI cMtchgId> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06- 04<BirthDt> <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> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO P 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> </pre>

<pre> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> </ExctgPrsn> </Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> </AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>DEAL</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> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> </AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>DEAL</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> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> </AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	--	---

Kdyby místo toho Investiční podnik Y jednal v „jakémkoli jiném postavení“, jak by Investiční podnik Y hlásil?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 2 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 3 Investiční podnik Y
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'		
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	,INTC'	,INTC'
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí			
16	Identifikační kód prodávajícího	,INTC'	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1	{NATIONAL_ID} Zákazníka 2
18	Jméno (jména) prodávajícího		,JEAN'	,JOSE, LUIS'
19	Příjmení prodávajícího		,COCTEAU'	,RODRIGUEZ, DE LA TORRE'
20	Prodávající – datum narození		,1962-06-04'	,1976-02-27'
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,false'	,false'
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího			
27	Identifikační kód předávajícího podniku pro prodávajícího		{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
28	Datum a čas obchodování	,2018-06-24T13:20:52.1456Z'	,2018-06-24T13:20:52.1456Z'	,2018-06-24T13:20:52.1456Z'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
30	Množství	,700'	,500'	,200'

33	Cena	,21'	,21'	,21'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'	,EUR'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{NATIONAL_ID} Obchodníka 1	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí		,GB'	,GB'
59	Provedení obchodu v rámci podniku	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4	{NATIONAL_ID} Obchodníka 4
60	Země pobočky dohlížející na osobu odpovědnou za provedení	,IT'	,IT'	,IT'
62	Ukazatel prodeje na krátko		,SESH'	,SELL'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hlášení č. 2 Investičního podniku Y	Hlášení č. 3 Investičního podniku 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> </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> </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> </pre>

<pre> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgld>1234</TradPlcMtgld> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> </ExctgPrsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> </Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> </Tx> <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> </InvstmtDcsnPrsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> </Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> </pre>	<pre> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> </Tx> <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> </InvstmtDcsnPrsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> </Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </pre>
---	--	--

	<pre> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> > <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> ch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR R</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSel lgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Kdyby Investiční podnik Y jednal párováním pokynů na vlastní účet, potom by hlášení byla přesně stejná jako výše, jen v postavení by se vyplnilo „MTCH“.

5.28 Přímý elektronický přístup (DEA)

Poskytovatel DEA i zákazník DEA, pokud jde o investiční podnik, předkládají hlášení o obchodu (s výhradou výjimky uvedené ve variantě B).

Při hlášení obchodů dbá poskytovatel DEA na to, aby se identifikoval jako subjekt provádějící obchod (pole 4 Identifikační kód subjektu provádějícího obchod). Vzhledem k tomu, že uživatel DEA (zákazník) provádí rozhodnutí o provedení obchodu, poskytovatel DEA vyplní pole Provedení obchodu v rámci podniku hodnotou 'NORE', jak je stanoveno v 5.12. Poskytovatel DEA nikdy nevyplňuje pole 57 (Investiční rozhodnutí v rámci podniku), protože se nikdy nezapojuje do investičního rozhodnutí, které je povinností zákazníka DEA. Poskytovatel DEA dále hlásí obchody v postavení AOTC nebo MTCH (pole 29).

Zákazník DEA ve svém hlášení o obchodu identifikuje jako kupujícího (pole 7 – Identifikační kód kupujícího) nebo případně prodávajícího (pole 16 – Identifikační kód prodávajícího) poskytovatele DEA, nikoli trh. Dále vždy vyplňuje v poli 36 (Systém) „XOFF“, protože není subjektem čelícím trhu. Je však třeba zdůraznit, že pokud zákazník DEA jedná na účet zákazníka a pokud předal údaje o tomto zákazníkovi podle podmínek uvedených v článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nehlásí zákazník DEA obchod, protože všechny relevantní informace budou poskytnuty příslušnému orgánu v hlášení o obchodu předkládaném poskytovatelem DEA.

5.28.1 Scénář 1: zákazník DEA obchoduje na vlastní účet bez základního zákazníka

Příklad 80

Investiční podnik X (zákazník DEA) využívá členský kód Investičního podniku Y (poskytovatel DEA), aby zadal pokyn v Obchodním systému M. Pokyn Investičního podniku X spočívá v nákupu finančních nástrojů v Obchodním systému M. V rámci Investičního podniku X učinil Obchodník 1 investiční rozhodnutí, zatímco Obchodník 2 je odpovědný za zadání pokynu k provedení prostřednictvím zařízení pro přímý elektronický přístup poskytnutého Investičním podnikem Y. Obchodní systém M vygeneruje identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) „1234“.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hodnoty hlášení č. 2 Investičního podniku X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	„1234“	
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Y
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		
25	Předání ukazatele pokynů	„false“	„false“
29	Postavení	„AOTC“	„DEAL“
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	„XOFF“
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		{NATIONAL_ID} Obchodníka 1
59	Provedení obchodu v rámci podniku	„NORE“	{NATIONAL_ID} Obchodníka 2

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Y (Poskytovatel DEA)	Hlášení č. 1 Investičního podniku X (Zákazník DEA)
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></pre>

<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchId>1234</TradPlcMtchId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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>
---	---

Podle tohoto scénáře, je v rámci Investičního podniku X obchodník, který učiní investiční rozhodnutí, jiný než obchodník, který zadává pokyn k provedení. Pokud je za investiční rozhodnutí i provedení odpovědný pouze jeden obchodník v rámci Investičního podniku X, vyplní se v polích 57 a 59 v hlášeních podniku X vnitrostátní identifikační kód tohoto obchodníka.

5.28.2 Scénář č. 2: Zákazník DEA jedná na účet zákazníka

5.28.2.1 Varianta A: žádné předání údajů o zákazníkovi poskytovateli DEA

Příklad 81

Investiční podnik X (zákazník DEA) použije členský kód Investičního podniku Y (poskytovatel DEA), aby zadal pokyn v Obchodním systému M. Pokyn Investičního podniku X spočívá v nákupu finančních nástrojů v Obchodním systému M. Investiční podnik X jedná na účet Zákazníka 1, jehož údaje nejsou předány Investičnímu podniku Y. Investiční rozhodnutí učinil Zákazník 1. V rámci Investičního podniku X odpovídá Obchodník 1 za zadání pokynu k provedení prostřednictvím zařízení DEA poskytovaného Investičním podnikem Y. Obchodní systém M vygeneruje TVTIC 1234.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik X
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'	
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku Y
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	,true'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		
59	Provedení obchodu v rámci podniku	,NORE'	{NATIONAL_ID} Obchodníka 1

Znáznění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku Y (Poskytovatel DEA)	Hlášení č. 2 Investičního podniku X (Zákazník DEA)
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ...</pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...</pre>

<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> ... </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <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 Varianta B: předání údajů o zákazníkovi poskytovateli DEA

Příklad 82

Investiční podnik X (zákazník DEA) použije členský kód Investičního podniku Y (poskyvatel DEA), aby zadal pokyn v Obchodním systému M. Pokyn Investičního podniku X spočívá v nákupu finančních

nástrojů v Obchodním systému M. Investiční podnik X jedná na účet Zákazníka 1, jehož údaje jsou předány Investičnímu podniku Y podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590. Obchodní systém M vygeneruje TVTIC 1234. Protože Investiční podnik X splňuje podmínky pro předání podle článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, nevytváří hlášení o obchodu.

Jak hlásí Investiční podnik Y?

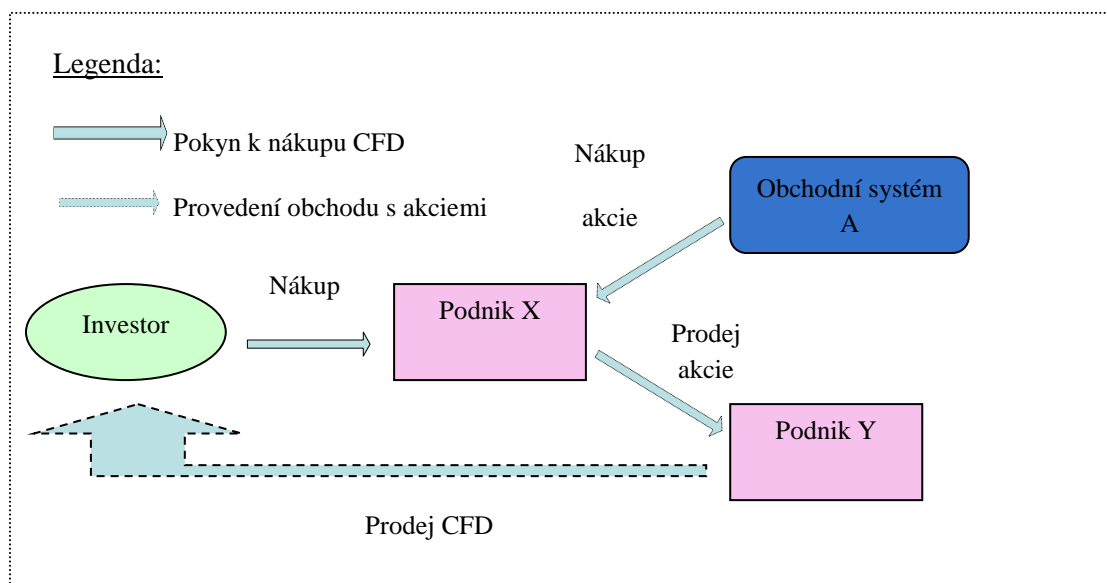
Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y	Znázornění XML
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	,1234'	<Tx> <New> ...
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1	<Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ...
12	Kód kupujícího s rozhodovací pravomocí		<Othr> ...
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr>
21	Kód prodávajícího s rozhodovací pravomocí		</Prsn> </Id> </AcctOwnr>
25	Předání ukazatele pokynů	,false'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
26	Identifikační kód předávajícího podniku pro kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
29	Postavení	,AOTC'	</Sellr>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	<OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>
57	Investiční rozhodnutí v rámci podniku		<TrnsmttgBuyr>12345678901234567890</TrnsmttgBuyr> </OrdTrnsmssn>
58	Země pobočky odpovědné za osobu, která činí investiční rozhodnutí		<Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn>
59	Provedení obchodu v rámci podniku	,NORE'	<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
60	Země pobočky dohlížející na osobu		</Tx> <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt>

	odpovědnou za provedení		<code></ExctgPrsn></code> ... <code></New></code> <code></Tx></code>
--	-------------------------	--	---

5.29 Zajištění prostřednictvím rozdílových smluv (CFD)

Příklad 83

Zákazník 1 vydává pokyn Investičnímu podniku X na rozdílové smlouvy (CFD) ke konkrétní podkladové akci (e.g. Vodafone). Kód ISIN podkladové akcie je GB00BH4HKS39. Investiční podnik X kupuje akcii v Obchodním systému M (aby získal zajištění) a předává tento obchod (prodává akcii) Investičnímu podniku Y (svému hlavnímu makléři), který poté uzavře rozdílovou smlouvu přímo s Zákazníkem 1. Investiční podniky X a Y oba obchodují na vlastní účet.



V tomto scénáři mají Investiční podnik X i Podnik Y oznamovací povinnost, protože oba provedly obchody: Investiční podnik X kupuje a prodává akcii a Investiční podnik Y kupuje akcii a prodává rozdílovou smlouvu Zákazníkovi 1.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik X	Hodnoty hlášení č. 2 Investiční podnik X	Hodnoty hlášení č. 1 Investiční podnik Y	Hodnoty hlášení č. 2 Investiční podnik Y ³¹
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y	{NATIONAL_ID} Zákazníka 1
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
29	Postavení	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'	,DEAL'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'	,XXXX'
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} akcií Vodafone	{ISIN} akcií Vodafone	{ISIN} akcií Vodafone	
42	Úplný název nástroje				,VODAFONE CFD'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1 Investičního podniku X	Hlášení č. 2 Investičního podniku X	Hlášení č. 1 Investičního podniku Y	Hlášení č. 2 Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEA N#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </pre>

³¹ Bližší informace k tomu, jak hlásit nástroje rozdílových smluv viz oddíl 5.35.4.

<pre> <LEI>1111111111111111 111111</LEI> </Id> </AcctOwNr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradV n> ... </Tx> ... <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</ Id> </FinInstrm> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwNr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</ Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>123456789012 34567890</LEI> </Id> </AcctOwNr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39 </Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Othr> </Prsn> </AcctOwNr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwNr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJK LMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwNr> </Sellr> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL< /TradgCpcty> ... <TradVn>XXXX</Tra dVn> </Tx> <FinInstrm> <FinInstrmGnlAttrbts > <FullNm>VODAFON E CFD</FullNm> ... </FinInstrmGnlAttrbts > ... </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	---	--

Hlášení č. 2 Investičního podniku Y bude obsahovat další informace o referenčních údajích o nástroji nezobrazené výše. Hlášení rozdílových smluv OTC viz část IV těchto obecných pokynů.

5.30 Hlášení předložené obchodním systémem o obchodu provedeném prostřednictvím jeho systémů podle čl. 26 odst. 5 nařízení MiFIR

Podle čl. 26 odst. 5 nařízení MiFIR musí obchodní systémy předkládat hlášení o obchodech ve vztahu k obchodům s finančními nástroji obchodovanými na jejich platformách, které prostřednictvím jejich systémů uskutečňují podniky, na něž se nařízení MiFIR nevztahuje.

Obchodní systém musí vyplnit všechny údaje, které by musel podnik hlásit, pokud by se na něj vztahovalo nařízení MiFIR, jak uvádí tabulka 2 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, včetně označení investičního rozhodnutí v rámci podniku a provedení v rámci podniku, příznaků výjimek a ukazatelů a označení k identifikaci zákazníka, pokud je to relevantní. Pokud podnik obchoduje na vlastní účet, tyto údaje se uvádějí z pohledu podniku. Pokud podnik obchoduje za zákazníka párováním pokynů na vlastní účet nebo v „jakémkoli jiném postavení“, obchodní systém

vyplní další údaje do polí 8–15 (pokud zákazník kupuje) nebo do polí 17–24 (pokud zákazník prodává) a ukazatel prodeje na krátko pro zákazníka a ukazatel komoditního derivátu, pokud se použije. Ukazatele prodeje na krátko a komoditního derivátu se vyplní z pohledu zákazníka. Pokud jde o identifikaci provádějícího podniku (pole 4) a jeho zákazníka (pole 7 a pole 16), pokud jsou způsobilí k LEI, platí požadavky podle článku 5 a čl. 13 odst. 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 a čl. 26 odst. 6 nařízení MiFIR. U zákazníků, kteří nejsou způsobilí ke kódu LEI, zkontroluje obchodní systém, zda uvedený vnitrostátní identifikační kód neobsahuje zjevné chyby ani opomenutí.

5.30.1 Podnik obchoduje na vlastní účet

Příklad 84

Podnik, který není investičním podnikem, Podnik R, kupuje finanční nástroje v obchodním systému pro zákazníka. LEI Podniku R je „RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR“. Organizátor obchodního systému má LEI „TVTDTVTVTVTVTVTVTVTV“. Obchodní systém vygeneruje identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) „55555555“ a referenční číslo obchodu pro hlášení o obchodu „6868689“.

Jak hlásí Obchodní systém M?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
2	Referenční číslo obchodu	‘6868689’	<Tx> <New>
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	‘55555555’	... <TxId>6868689</TxId>
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Podniku R	<ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty>
5	Investiční podnik, na nějž se vztahuje směrnice 2014/65/EU	‘false’	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} organizátora Obchodního systému M	<LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Podniku R	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	</Id> </AcctOwnr> </Sellr>
29	Postavení	‘DEAL’	... <Tx>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn>

			<pre> <TradPlcMtchglId>55555555</TradPlcMtchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Pole, které se vztahují k nástroji, se vyplní, jak uvádí část IV.

Pokud existuje související mimoburzovní obchod se zákazníkem ze strany podniku, nemusí být hlášen obchodním systémem, protože se neprovádí prostřednictvím systémů obchodního systému.

5.30.2 Podnik obchoduje „párováním pokynů na vlastní účet“ nebo v „jakémkoli jiném postavení“ za jednoho zákazníka

Příklad 85

Podnik, který není investičním podnikem, Podnik R, kupuje akcie v knize pokynů Obchodního systému M pro zákazníka, Podnik S, který rovněž jedná za zákazníka, Zákazníka T. LEI Podniku R je „RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR“. LEI Podniku S je „SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS“. Organizátor obchodního systému má LEI „TVTDTVTVTVTVTVTVTVTV“. Obchodní systém vygeneruje identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) „55555555“ a referenční číslo obchodu pro hlášení o obchodu „6868689“.

Pokud Podnik R jedná v „jakémkoli jiném postavení“, bude obchodní systém hlásit takto:

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
2	Referenční číslo obchodu	„6868689“	<pre> <Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> </pre>
3	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	„55555555“	<pre> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> </pre>
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Podniku R	<pre> <SubmitgPty>TVTDTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>
5	Investiční podnik, na nějž se vztahuje směrnice 2014/65/EU	„false“	
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} organizátora Obchodního systému M	

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Podniku S	</Sellr> ... <Tx>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId>
29	Postavení	„AOTC“	</Tx>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	... </New> </Tx>

Pole, které se vztahují k nástroji, se vyplní, jak uvádí část IV.

Protože Podnik R obchoduje v „jakémkoli jiném postavení“, hlášení o obchodu předložené obchodním systémem musí identifikovat bezprostředního základního zákazníka (Podnik S), nikoli Zákazníka T.

Kdyby měl Podnik R obchodovat párováním pokynů na vlastní účet, hlášení by bylo stejné, pouze v poli Postavení by se vyplnilo „MTCH“.

5.30.3 Podnik shrnuje pokyny od několika zákazníků

Pokud podnik seskupuje pokyny od několika zákazníků v obchodním systému a jedná v „jakémkoli jiném postavení“ nebo párováním pokynů na vlastní účet, obchodní systém hlásí údaje o každém zákazníkovi. Bude to zahrnovat hlášení dalších údajů v polích 8–15 pro kupujícího a ekvivalentních polích pro prodávajícího a ukazatele prodeje na krátko, případně ukazatele komoditního derivátu pro daného zákazníka.

Příklad 86

Podnik, který není investičním podnikem, Podnik R, kupuje akcie v knize pokynů Obchodního systému M pro tři zákazníky, A, B a C. Podnik R jedná v „jakémkoli jiném postavení“. Organizátor obchodního systému má LEI „TVT V T V T V T V T V T V T V T V T V“. Obchodní systém vygeneruje identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) „55555555“ a referenční číslo obchodu pro hlášení na tržní straně „6868689“ a pro alokace zákazníkům „6868690“, „6868691“ a „6868692“.

Jak hlásí Obchodní systém M?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1 Obchodní systém M	Hodnoty hlášení č. 2 Obchodní systém M	Hodnoty hlášení č. 3 Obchodní systém M	Hodnoty hlášení č. 4 Obchodní systém M
2	Referenční číslo obchodu	„6868689“	„6868690“	„6868691“	„6868692“
3	Identifikační kód obchodů	„55555555“			

	v obchodním systému				
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Podniku R	{LEI} Podniku R	{LEI} Podniku R	{LEI} Podniku R
5	Investiční podnik, na nějž se vztahuje směrnice 2014/65/EU	,false'	,false'	,false'	,false'
6	Identifikační kód subjektu podávajícího hlášení	{LEI} organizátora Obchodního systému M	{LEI} organizátora Obchodního systému M	{LEI} organizátora Obchodního systému M	{LEI} organizátora Obchodního systému M
7	Identifikační kód kupujícího	,INTC'	{LEI} Zákazníka A	{LEI} Zákazníka B	{LEI} Zákazníka C
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany pro Obchodní systém M	,INTC'	,INTC'	,INTC'
29	Postavení	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'	,AOTC'
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	,XOFF'	,XOFF'	,XOFF'

Znárodnění XML:

Hlášení č. 1 Obchodního systému M	Hlášení č. 2 Obchodního systému M	Hlášení č. 3 Obchodního systému M	Hlášení č. 4 Obchodního systému M
<pre><Tx> <New> <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</I nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>6868690</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</I nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>6868691</TxId> > <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>6868692</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>

<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111111 111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradV n> ... <TradPlcMtchglD>5555 5555</TradPlcMtchglD > </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>CCCCCCCCC CCCCCCCCCC</L EI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>
---	---	--	---

Kdyby měl Podnik R obchodovat párováním pokynů na vlastní účet, hlášení by bylo stejné, pouze v poli Postavení by se vyplnilo „MTCH“.

5.31 Obchody zajišťující financování

Obecný popis toho, jak se oznamovací povinnost vztahuje na obchody zajišťující financování, viz příslušný pododíl 5.6.2 (výjimky podle čl. 2 odst. 5 písm. a) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590).

Příklad 87

Centrální banka CB (s LEI CBCBCBCBCBCBCBCBCB) kupuje státní dluhopisy (ISIN NO0010732555) od Investičního podniku X.

Hlášení o obchodu ukázané níže je pouze z pohledu Investičního podniku X.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New>

7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} centrální banky CB	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</Exctg Pty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CBCBCBCBCBCBCBCBCBCBC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <FinInstrm> <Id>NO0010732555</Id> </FinInstrm> <AddtlAttrbts> ... <SctiesFincgTxInd>true</SctiesFinc gTxInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} státních dluhopisů	
65	Ukazatel obchodů zajišťujících financování	,true'	

Část IV – Hlášení různých typů nástrojů

5.32 Zásady

Pokud jde o derivátový nástroj na jiný derivátový nástroj, například opce na futures na akcii, kód ISIN, který se vyplní v poli Kód podkladového nástroje (pole 47) hlášení o obchodu, je přímý podkladový nástroj tj. v tomto příkladu smlouva o futures, nikoli konečný podkladový nástroj (v tomto příkladu akcie). To by neplatilo u derivátu přijatého k obchodování nebo obchodovaného v obchodním systému, protože se použije pouze identifikační kód nástroje (pole 41).

„NOAP“ se použije v poli Cena, pokud pro daný obchod není cena relevantní (např. dary). „PNDG“ se použije, pokud není cena dostupná, protože ještě není stanovená. Hodnota „0“ se nesmí použít jako defaultní hodnota.

Finanční nástroje, kdy je podkladovým aktivem index, se hlásí. Sem patří rovněž případy, kdy index je „složený z finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému“. V této souvislosti je třeba poznamenat, že textem „složený z finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému“ v čl. 26 odst. 2 písm. c) nařízení MiFIR se rozumí index i koš.

5.33 Identifikace finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému nebo dostupných v seznamu ESMA

Příklad 88

Investiční podnik nabude finanční nástroj s kódem ISIN BE9999999999.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	<Tx>
42	Úplný název nástroje		<New>
43	Klasifikace nástroje		..
44	Jmenovitá měna 1		<FinInstrm>
45	Jmenovitá měna 2		<Id>BE9999999999</Id>
46	Cenový multiplikátor		</FinInstrm>
47	Kód podkladového nástroje		...
48	Název podkladového indexu		</New>
49	Doba trvání podkladového indexu		</Tx>
50	Typ opce		
51	Realizační cena		
52	Měna realizační ceny		
53	Realizace opce		
54	Datum splatnosti		
55	Datum konce platnosti		
56	Druh dodání		

V tomto případě se vyplní pouze pole Identifikační kód nástroje. Pokud jsou však vyplněna také pole související s referenčními údaji o nástroji, příslušný orgán hlášení o obchodu nezamítne.

5.34 Identifikace finančních nástrojů neobchodovaných v obchodním systému nebo nedostupných v seznamu ESMA

5.34.1 Finanční nástroje obchodované na organizované obchodní platformě mimo Unii (systém mimo Evropský hospodářský prostor)

Příklad 89

Investiční podnik obchoduje s derivátovými futures (ISIN US0000000000) za 11,4653 dolarů za podkladové aktivum na organizované obchodní platformě mimo Unii (Obchodní platforma U). Podkladový nástroj (ISIN GB0000000000) je obchodován v obchodním systému.

Počet jednotek podkladového aktiva reprezentovaných jednou derivátovou smlouvou je 1000.

Kód CFI pro futures je FFSCSX a smlouva se vypořádává v hotovosti.

Segment MIC obchodního systému mimo Evropský hospodářský prostor je XUSA a datum konce platnosti futures je 19. června 2018.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
36	System	Segment {MIC} Obchodní platformy U	<New> ... <Tx> ...
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN futures}	<TradVn>XUSA</TradVn>
42	Úplný název nástroje	‚FUTURE CONTRACT‘	... </Tx>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<FinInstrm>
46	Cenový multiplikátor	‚1000‘	<Othr>
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového aktiva	<FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000000</Id> <FullNm>FUTURE
55	Datum konce platnosti	‚2018-06-19‘	CONTRACT</FullNm>
56	Druh dodání	‚CASH‘	<ClsfctnTp>FFSCSX</ClsfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New>

Pokud pro finanční nástroj obchodovaný na organizované obchodní platformě mimo Unii existuje ISIN, vyplní se v poli 41. Pole 42 až 56 by se rovněž musela vyplnit, pokud by ISIN nebyl na seznamu referenčních údajů vedeném ESMA.

5.34.2 OTC deriváty

Příklad 90

Investiční podnik obchoduje mimoburzovně s derivátovými futures. Derivátové futures nemají ISIN, ale podkladový nástroj (ISIN GB0000000000) je přijatý k obchodování nebo obchodovaný v obchodním systému.

Počet jednotek podkladového aktiva reprezentovaných jednou derivátovou smlouvou je 1000.

Kód CFI pro futures je FFSCSX a datum konce platnosti pro futures je 19. června 2018. Smlouva se vypořádává v hotovosti.

Pole Cenový multiplikátor se také vyplní s odkazem na přímý podkladový nástroj.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
36	System	,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> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,FUTURE CONTRACT JUN 2018'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,1000'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového nástroje	
55	Datum konce platnosti	,2018-06-19'	
56	Druh dodání	,CASH'	

Rozdíl mezi 5.34.1 a 5.34.2 je v tom, že identifikační kód nástroje (pole 41) není ve scénáři 5.34.2 vyplněn.

5.35 Hlášení specifických finančních nástrojů

5.35.1 Akciové nástroje nebo nástroje podobné akciovým

Příklad 91

Investiční podnik obchoduje 10 ADR (ISIN: US0000000001) na americkém trhu (MIC: XUSA). Podkladový nástroj (ISIN: GB0000000001) je přijat k obchodování nebo obchodovaný v obchodním systému. Kód CFI je EDSXFB.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,10'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </pre>
36	System	Segment {MIC} Obchodní platformy U	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	</Qty>
46	Cenový multiplikátor	,1'	...
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového nástroje	<pre> <TradVn>XUSA</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000001</Id> <ClssfctnTp>EDSXFB</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>

5.35.2 Dluhopisy a jiné formy dluhových cenných papírů

5.35.2.1 Scénář, kdy obchod proběhl v čisté ceně³²

Příklad 92

Investiční podnik nabude dluhopis nebo dluhový cenný papír EDF 2.25% 2021 (Kód ISIN FR0011637586) mimoburzovním obchodováním za 98. Nominální částka obchodu je 1 000 000 EUR.

Čistá částka za tento obchod je 982 650,68 EUR.

Zvažujme, že pro účel tohoto příkladu:

Statické vlastnosti (definované při vydání finančního nástroje) jsou:

- Datum splatnosti: 27. dubna 2021
- Nominální kupón: 2,25 %
- Frekvence kupónu: roční
- Metoda počítání dní: ACT/ACT (tj. skutečné/skutečné)³³

³² Čistá cena = hrubá cena – vzniklý úrok

³³ ACT/ACT je doporučená konvence ICMA pro dluhopisy.

- Konvence o datu vypořádání: 2 obchodní dny po datu obchodu

Proměnné (dynamické vlastnosti závislé na podmínkách na trhu) jsou:

- Datum obchodu: 5. června 2014
- Datum vypořádání: 9. června 2014 (podle konvence o datu vypořádání)
- Datum posledního kupónu: 27. dubna 2014
- Datum příštího kupónu: 27. dubna 2015
- Narostlý počet dní: 43 (tj. počet dní mezi datem posledního kupónu a datem vypořádání)
- Základ období: 365 (tj. počet dní mezi datem posledního kupónu a datem příštího kupónu)
- Množství: 1 000 000 (tj. nominální nebo peněžní hodnota obchodu)
- Čistá cena: 98
- Vzniklý úrok: 0,26506849 (tj. $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2.25}{1} \times \frac{43}{365}$)

Nominal coupon	Nominální kupón
Annual Coupon Frequency	Roční frekvence kupónu
Accrued Number of Days	Narostlý počet dní
Period Basis	Základ období

- Hrubá cena: 98,26506849 (tj. čistá cena + vzniklý úrok = 98 + 0,26506849)

Čistá částka se vypočítá takto (podle vzorce uvedeného v poli 35 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590):

Čistá částka = (čistá cena x nominální hodnota) + (narostlé kupóny x nominální hodnota), tj. $(\frac{98}{100} \times 1\,000\,000 \text{ EUR}) + (\frac{0,26506849}{100} \times 1\,000\,000) = 982\,650,68 \text{ EUR}$

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,1000000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>98</Pctg> </Pric> </Pric> </Tx> </pre>
31	Měna množství	,EUR'	
33	Cena	,98'	
35	Čistá částka	,982650,68'	
36	System	,XOFF'	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

			<pre> <NetAmt>982650.68</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0011637586</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.2.2 Scénář, kdy cena finančního nástroje je uvedena jako prostý diskontní výnos

Příklad 93

Investiční podnik nabude nizozemskou pokladniční poukázku DTB 0% 12/30/16 (Kód ISIN NL0011923107) obchodováním za -0,609 %. Nominální hodnota obchodu je 1 000 000 EUR.

Čistá částka za tento obchod je 1 002 611,97 EUR.

Zvažujme, že pro účel tohoto příkladu:

Statické vlastnosti (definované při vydání finančního nástroje) jsou:

- Datum splatnosti: 30. prosince 2016
- Metoda počítání dní: ACT/360
- Konvence o datu vypořádání: 2 obchodní dny po datu obchodu

Proměnné (dynamické vlastnosti závislé na podmínkách na trhu) jsou:

- Datum obchodu: 27. července 2016
- Datum vypořádání: 29. července 2016
- Počet dní do splatnosti: 154 (tj. počet dní od data vypořádání do data splatnosti)
- Základ období: 360 (tj. celkový počet dní podle konvence)
- Množství: 1 000 000 (tj. nominální nebo peněžní hodnota obchodu)
- Diskontní výnos poukázky: -0,609 %
- Čistá cena: 100,261197 (tj. $\frac{100}{1 + \frac{Yield \cdot Days\ until\ maturity}{100 \cdot Period\ Basis}} = \frac{100}{1 + \frac{-0.609 \cdot 154}{100 \cdot 360}}$)

Yield	Výnos
Days until maturity	Počet dní do splatnosti
Period Basis	Základ období

- Hrubá cena: 100,261197 (tj. čistá cena + vzniklý úrok = 100,261197 + 0)

Čistá částka se vypočítá takto (podle vzorce uvedeného v poli 35 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590):

Čistá částka = (čistá cena x nominální hodnota) + (narostlé kupóny x nominální hodnota), tj. $(\frac{100,261197}{100} \times 1\,000\,000 \text{ EUR}) + (0 \times 1\,000\,000 \text{ EUR}) = 1\,002\,611,97 \text{ EUR}$

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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	Měna množství	,EUR'	
33	Cena	,-0,609'	
34	Měna, v níž je uvedena cena		
35	Čistá částka	,1002611,97'	
36	Systém	,XOFF'	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

5.35.2.3 Scénář, kdy cena finančního nástroje (nulového kupónu) je uvedena jako výnos z dluhopisu

Příklad 94

Investiční podnik nabude Strip FRTR 0% 04/25/2041 (kód ISINFR0010773200) mimoburzovním obchodováním za 1,06 %. Nominální hodnota obchodu je 1 000 000 EUR.

Čistá částka za tento obchod je 770 343,52 EUR.

Zvažujeme, že pro účel tohoto příkladu:

Statické vlastnosti (definované při vydání finančního nástroje) jsou:

- Datum splatnosti: 25. dubna 2041
- Frekvence kupónu: žádná
- Metoda počítání dní: ACT/ACT

- Konvence o datu vypořádání: 2 obchodní dny po datu obchodu

Proměnné (dynamické vlastnosti závislé na podmínkách na trhu) jsou:

- Datum obchodu: 25. července 2016
- Datum vypořádání: 27. července 2016
- Základ období: 365
- Doba do splatnosti (od data vypořádání 27. července 2016 do data splatnosti 25. dubna 2041): „(24+272/365) let“
- Množství: 1 000 000 (tj. nominální nebo peněžní hodnota obchodu)
- Výnos z dluhopisu pro strip: 1,06 %
- Čistá cena: 77,0343516 (tj. $\frac{100}{(1+\frac{Yield}{100})^{Time\ to\ maturity}} = \frac{100}{(1+\frac{1,06}{100})^{(24+\frac{272}{365})}}$)

Yield	Výnos
Time to maturity	Doba do splatnosti

- Hrubá cena: 77,0343516 (tj. čistá cena + vzniklý úrok = 77,0343516 + 0)

Čistá částka se vypočítá takto (podle vzorce uvedeného v poli 35 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590):

Čistá částka = (čistá cena x nominální hodnota) + (narostlé kupóny x nominální hodnota), tj. $(\frac{77,0343516}{100} \times 1\ 000\ 000\ EUR) + (0 \times 1\ 000\ 000\ EUR) = 770343,52\ EUR$

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,1000000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Yld>1.06</Yld> </Pric> </Pric> <NetAmt>770343.52</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0010773200</Id> </pre>
31	Měna množství	,EUR'	
33	Cena	,1,06'	
34	Měna, v níž je uvedena cena		
35	Čistá částka	,770343,52'	
36	Systém	,XOFF'	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

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

5.35.2.4 Konvertibilní dluhopis

5.35.2.4.1 Scénář, kdy cena konvertibilního dluhopisu je jako čistá cena:

Příklad 95

Investiční podnik nabude Vodafone 2% 02/25/2019 (kód ISIN XS1371473601) mimoburzovním obchodováním za 114,00. Nominální hodnota obchodu je 1 000 000 GBP.

Čistá částka za tento obchod je 1 148 406,59 GBP.

Zvažujme, že pro účel tohoto příkladu:

Statické vlastnosti (definované při vydání finančního nástroje) jsou:

- Datum splatnosti: 25. února 2019
- Nominální kupón: 2 %
- Frekvence kupónu: Pololetní
- Metoda počítání dní: ICMA ACT/ACT
- Konvence o datu vypořádání: 2 obchodní dny po datu obchodu

Proměnné (dynamické vlastnosti závislé na podmínkách na trhu) jsou:

- Datum obchodu: 25. července 2016
- Datum vypořádání: 27. července 2016
- Datum posledního kupónu: 25. února 2016
- Datum příštího kupónu: 25. srpna 2017
- Narostlý počet dní: 153 (tj. počet dní mezi datem posledního kupónu a datem vypořádání)
- Základ období: 182 (tj. počet dní mezi datem posledního kupónu a datem příštího kupónu)
- Množství: 1 000 000 (tj. nominální nebo peněžní hodnota obchodu)
- Čistá cena: 114,00
- Vzniklý úrok: 0,84065934 (tj. $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2}{2} \times \frac{153}{182}$)

Nominal Coupon	Nominální kupón
Annual Coupon Frequency	Roční frekvence kupónu
Accrued Number of Days	Narostlý počet dní
Period Basis	Základ období

- Hrubá cena: 114,8406593 (tj. čistá cena + vzniklý úrok = 114,00 + 0,84065934)

Čistá částka se vypočítá takto (podle vzorce uvedeného v poli 35 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590):

Čistá částka = (čistá cena x nominální hodnota) + (narostlé kupóny x nominální hodnota), tj. $\left(\frac{114}{100} \times 1\,000\,000\text{ GBP}\right) + \left(\frac{0,84065934}{100} \times 1\,000\,000\text{ GBP}\right) = 1\,148\,406,59\text{ GBP}$.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,1000000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="GBP">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>114.00</Pctg> </Pric> </Pric> <NetAmt>1148406.59</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS1371473601</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	Měna množství	,GBP'	
33	Cena	,114,00'	
35	Čistá částka	,1148406,59'	
36	Systém	,XOFF'	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

5.35.2.4.2 Scénář, kdy je cena finančního nástroje uvedena v obchodní měně

Příklad 96

Investiční podnik nabude 10 000 konvertibilních dluhopisů CapGemini 0% 01/01/19 (kód ISIN FR0011600352) obchodováním OTC za 80 EUR. Čistá částka za tento obchod je 800 000 EUR = 10 000 x 80 EUR.

Zvažujme, že pro účel tohoto příkladu:

Statické vlastnosti (definované při vydání finančního nástroje) nejsou pro hlášení obchodů relevantní.

Proměnné (dynamické vlastnosti závislé na podmínkách na trhu) jsou:

- Množství: 10 000 (tj. počet jednotek finančního nástroje)
- Cena finančního nástroje vyjádřená v obchodní měně: 80 EUR

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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	Měna množství		
33	Cena	,80'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	
35	Čistá částka	,800000'	
36	Systém	,XOFF'	
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	

5.35.3 Opce

5.35.3.1.1 Akciová opce

Příklad 97

Investiční podnik koupí 10 akciových kupních opcí za 11,46 EUR na smlouvu od jiného investičního podniku. Kupní opce se neobchoduje v obchodním systému, ale podkladová akcie ano.

Cenový multiplikátor (počet podkladových akcií v jedné smlouvě) je 5, realizační cena (cena, za kterou se podkladové aktivum kupuje nebo prodává, když je opce uplatněna) je 70 EUR. ISIN akcie DE0000000001. Kód CFI je HESAVP.

Datum konce platnosti opční smlouvy je 31. prosince 2018 a vypořádává se fyzicky.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,10'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> </pre>
33	Cena	,11,46'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	

51	System	,XXXX'	...
41	Identifikační kód nástroje		<Qty> <Unit>10</Unit> </Qty>
42	Úplný název nástroje	,EQUITY CALL OPTION'	<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">11.46</Amt> </MntryVal>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	</Pric> </Pric>
46	Cenový multiplikátor	,5'	<TradVn>XXXX</TradVn>
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladové akcie	...
50	Typ opce	,CALL'	</Tx>
51	Realizační cena	,70'	<FinInstrm>
52	Měna realizační ceny	,EUR'	<Othr>
53	Realizace opce	,EURO'	<FinInstrmGnlAttrbts>
55	Datum konce platnosti	,2018-12-31'	<FullNm>EQUITY CALL OPTION</FullNm>
56	Druh dodání	,PHYS'	<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>

5.35.3.1.2 OTC indexová opční smlouva

Příklad 98

Investiční podnik prodává 50 FTSE 100 Index Bespoke kupních opčních smluv mimoburzovně za 2 GBP na smlouvu.

Podkladový nástroj je FTSE 100 Index (ISIN: GB0001383545).

Datum konce platnosti je 14. srpna 2018. Realizační cena je 3 500 a cenový multiplikátor je 25. Opční smlouva je evropského stylu a s dodáním v hotovosti.

Kód CFI pro opční smlouvu je HEIAVC.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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> <UndrlyInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0001383545</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlyInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> </New> </Tx> </pre>
33	Cena	,2'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,GBP'	
36	System	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,25'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového indexu	
48	Název podkladového indexu	{Vloží se název indexu}	
50	Typ opce	,CALL'	
51	Realizační cena	,3500'	
53	Realizace opce	,EURO'	
55	Datum konce platnosti	,2018-08-14"	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> </Othr> </UndrlygInstrm> <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 Rozdílová smlouva

Příklad 99

Investiční podnik obchoduje rozdílovou smlouvu (CFD). Podkladová akcie Vodafone je přijatá k obchodování na regulovaném trhu, ale rozdílová smlouva není v obchodním systému obchodovaná.

Počet obchodovaných rozdílových smluv 10 000. Cena rozdílové smlouvy je 3,374 EUR. Kód ISIN podkladové akcie (Vodafone) je GB00BH4HKS39.

Kód CFI pro rozdílovou smlouvu je OCEICN. Cenový multiplikátor je 1 a odráží skutečnost, že jedna rozdílová smlouva představuje jednu jednotku podkladového nástroje.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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> </pre>
33	Cena	,3,374'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	
36	System	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,VODAFONE CFD'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,1'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladové akcie	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB00BH4HKS39</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.5 Sázka na spready

5.35.5.1 Sázka na spready u akcie

Příklad 100

Investor obchoduje sázku na spready u akcie s denním obnovováním. Sázka na spready se neobchoduje v obchodním systému, ale podkladová akcie ano.

Částka vsazená na sázku je 0,5 GBP na cenový pohyb v menší měnové jednotce.

Referenční cena podkladového finančního nástroje (ABC PLC) je 102,23 EUR.

Úplný název nástroje je volné textové pole, které vyplní subjekt provádějící obchod: ABC BET SEP 15 SPREAD. Kód CFI pro sázku na spready u akcie je JESXSC.

Cenový multiplikátor je pohyb na bod v ceně podkladového nástroje: 100. tj. 100 centů k 1 EUR. Proto se u každého pohybu v centech upraví zisk nebo ztráta investorů o 0,50 GBP.

Kód ISIN podkladové akcie je GB0000000004.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,0,50'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">0.50</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">102.23</Amt> </pre>
31	Měna množství	,GBP'	
33	Cena	,102,23'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	
36	System	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,ABC BET SPREAD'	

43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	</MntryVal>
46	Cenový multiplikátor	,100'	</Pric> </Pric>
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladové akcie	<TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx>
55	Datum konce platnosti		<FinInstrm>
56	Druh dodání	,CASH'	<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>

U sázek na spready s denním obnovováním se musí hlásit pouze obchod při počátečním otevření a obchod při koncovém uzavření smlouvy. Datum konce platnosti se nevyplňuje.

5.35.5.2 Sázky na spready u dluhopisových futures

Příklad 101

Kód ISIN vyplněný v poli Kód podkladového nástroje (pole 47) hlášení o obchodu patří přímému podkladovému finančnímu nástroji. V tomto příkladu jde o identifikační kód dluhopisových futures, nikoli konečného podkladového finančního nástroje (tj. dluhopisu).

Investor obchoduje sázku na spready s denním obnovováním u dluhopisových futures, kdy jsou tyto dluhopisové futures obchodovány v obchodním systému.

Částka vsazená na sázku je 2 GBP na bod. Referenční cena (v bazických bodech) podkladového finančního nástroje je 9 100.

Úplný název nástroje je volné textové pole, které vyplní subjekt provádějící obchod: Bond Future BET 27MAY15.

Kód CFI pro sázku na spready u dluhopisových futures je JCAXSC.

Cenový multiplikátor je pohyb na bod v ceně za podkladový nástroj: 1. Kód ISIN u podkladových dluhopisových futures je GB1234567891.

Č.	Pole	Hodnoty	Znárodnění XML
30	Množství	,2'	<Tx>
31	Měna množství	,GBP'	<New>
33	Cena	,9100'	...
36	System	,XXXX'	<Tx>
41	Identifikační kód nástroje		...
42	Úplný název nástroje	,BOND FUTURE BET 27MAY15'	<Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<Pric> <Pric> <BsisPts>9100</BsisPts> </Pric>
46	Cenový multiplikátor	,1'	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladovýc h futures	...
55	Datum konce platnosti		</Tx> <FinInstrm> <Othr>
56	Druh dodání	,CASH'	<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>

5.35.5.3 Sázka na spready u indexu

Příklad 102

Investor obchoduje sázku na spready u akciového indexu tvořeného nejméně jedním finančním nástrojem, který je přijat k obchodování v obchodním systému. Sázka na spready není obchodovaná v obchodním systému.

Částka vsazená na sázku je 10 GBP na pohyb na bod indexu a referenční cena podkladového finančního nástroje je 9 340.

Úplný název nástroje je volné textové pole, které vyplní subjekt provádějící obchod: FTSE Index BET.

Kód CFI pro sázku na spready u akciového indexu je JEIXSC.

Platnost pozice sázky na spready má skončit v T+1, kdy T je 2018-10-27.

Cenový multiplikátor je pohyb na bod indexu, to je 1. U každého pohybu na bod indexu se upraví zisk nebo ztráta investorů o 10 GBP.

Kód ISIN indexu je GB0001383545.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,10'	<Tx>
31	Měna množství	,GBP'	<New>
33	Cena	,9340'	...
36	Systém	,XXXX'	<Tx>
41	Identifikační kód nástroje		...
42	Úplný název nástroje	,FTSE INDEX BET'	<Qty>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal>
46	Cenový multiplikátor	,1'	</Qty>
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového indexu	<Pric>
48	Název podkladového indexu	,FTSE100'	<Pric>
55	Datum konce platnosti	,2018-10-28'	<BsisPts>9340</BsisPts>
56	Druh dodání	,CASH'	</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>

5.35.5.4 Sázka na spready u OTF obchodované FX dohody o budoucí úrokové sazbě (FRA)

Příklad 103

Investor provede sázku na jednorouční GBP/USD dohodu o budoucí úrokové sazbě (GBP/USD FRA JUN16). Sázka na spready není obchodovaná v obchodním systému.

GBP/USD FRA JUN16 je obchodovaná za 1,5355 (směnný kurz).

Vsazená částka je 5 GBP na pohyb v menší měnové jednotce. Cenový multiplikátor je pohyb na bod v menší měně referenční ceny podkladového nástroje: 100.

Kód ISIN GBP/USD FRA JUN16 je GB0000000006.

Kód CFI pro sázku na spready u GBP/USD FRA je JFRXSC.

Datum konce platnosti FRA je 30. června 2016 a jde o datum konce platnosti sázky na spready.

Sázka na spready bude dodána v hotovosti.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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> </DerivInstrmAttrbts> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> </pre>
31	Měna množství	,GBP'	
33	Cena	,1,5355'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,GBP'	
36	System	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,GBP/USD FRA JUN16 BET'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,100'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladové FRA	
55	Datum konce platnosti	,2016-06-30'	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> <ISIN>GB0000000006</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.5.5 Sázka na spready u OTF obchodované úrokové opce

Příklad 104

Investor zadá sázku 2 GBP na bazický bod u šestiměsíční GBP opce LIBOR.

Šestiměsíční librová opce LIBOR se obchoduje za 0,71375 procent na T. Kód ISIN šestiměsíční GBP opce LIBOR je GB0000000007.

Kód CFI pro sázku na spready u librové opce LIBOR je JRMXSC.

Datum konce platnosti opce GBP LIBOR je 17. prosince 2018, což je také datum konce platnosti sázky na spready.

Cenový multiplikátor je 10 000, protože 1 bazický bod je 0,01 %. Zisk nebo ztráta investorů se upravuje o 2 GBP na každý pohyb o 0,01 procenta v referenční ceně.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
30	Množství	,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> <DerivInstrmAttrbts> </pre>
31	Měna množství	,GBP'	
33	Cena	,0,71375'	
36	Systém	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,OPTION GBP LIBOR DEC15 BET'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,10000'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladové opce	
55	Datum konce platnosti	,2018-12-17'	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> <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>
--	--	--	--

Podkladový nástroj identifikovaný v hlášení o obchodu je úroková opční smlouva.

5.35.6 Swapy úvěrového selhání

Příklad 105

Investiční podnik X kupuje mimoburzovně swap úvěrového selhání (CDS) u Allianz SE s hodnotou 1 000 000 (jeden milion) EUR za kupón 100 bazických bodů od Investičního podniku Y. CDS se vypořádává v hotovosti.

Konec platnosti CDS je dne 30. července 2020.

Investiční podnik X obdrží od Investičního podniku Y platbu předem ve výši 33 879 EUR.

Kód ISIN podkladového dluhopisu je ZA2344558978 a je obchodovaný v obchodním systému. Kód CFI pro CDS je SCUCCC.

Následující hlášení o obchodu je pouze z pohledu Investičního podniku X.

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
30	Množství	,1000000'	
31	Měna množství	,EUR'	
33	Cena	,100'	
36	System	,XXXX'	</Buyr>
38	Platba předem	, -33879'	<Sellr>
39	Měna platby předem	,EUR'	<AcctOwnr> <Id>
41	Identifikační kód nástroje		

42	Úplný název nástroje	„ALLIANZ SE SNR CDS“	<pre> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">100000</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> </pre>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,1‘	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladového dluhopisu	
55	Datum konce platnosti	„2021-06-20“	
56	Druh dodání	„CASH“	

Pokud nedošlo k žádné platbě předem, v poli 38 se vyplní „0“.

Pokud Investiční podnik X platbu předem obdrží, nikoli uhradí, bude hodnota platby předem vyplněná v poli 38 záporná.

5.35.7 Swapy

Pokud obchod zahrnuje samostatné peněžní toky a směr nelze naznačit odkazem na pole kupujícího/prodávajícího, použije se k označení znaménko „+“ nebo „-“ před kódem podkladového nástroje, případně před názvem podkladového indexu. Znaménko „+“ znamená, že kupující obdrží podkladový finanční nástroj (plnění), zatímco znaménko „-“ znamená, že kupující hradí podkladový finanční nástroj (plnění). Znaménka „+“ a „-“ byla zahrnuta do tabulek v příkladech, aby ilustrovala, jaký je směr swapu, tyto symboly se však objeví ve formátu XML jako XML tagy, doprovázející příslušnou hodnotu podléhající hlášení (např. kód podkladového nástroje). Znaménka „+“ nebo „-“ jsou zastoupena v textu XML jako „Swpln“ nebo „SwpOut“.

Od investičních podniků se očekává, že budou používat znaménka „-“ a „+“ přesně a konzistentně. V případě, že kupujícího nebo prodávajícího swapové smlouvy nelze odvodit z popisu v příslušných polích nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, např. akciový swap se dvěma akciovými komponentami, měla by znaménka „+“ a „-“ v poli 47 a/nebo 48 adekvátním způsobem odrážet, co podnik, identifikovaný jako kupující v daném hlášení o obchodu, obdrží a co podnik, identifikovaný jako prodávající v daném hlášení o obchodu, zaplatí.

Platba předem se může uplatnit u jakékoli swapové smlouvy.

5.35.7.1 Akciový swap (jedna akciová komponenta)

Příklad 106

Investiční podnik X obchoduje OTC akciový swap s Investičním podnikem Y. Podkladová akcie je přijata k obchodování v obchodním systému. Podnik X obdrží riziko související s cenovým pohybem podkladové akcie a zaplatí LIBOR3M plus prémii 0,05 %.

Nominální hodnota swapové smlouvy je 1 000 000 EUR a referenční cena podkladového aktiva je 50 USD. Konec platnosti swapové smlouvy je dne 31. prosince 2018 a vypořádává se v hotovosti.

Úplný název nástroje je BAYER EQS LIBOR3M+ 0.05%. Kód CFI pro akciový swap je SESPXC.

Podkladová akcie je Bayer AG NA (ISIN DE000BAY0017).

Podkladová úroková sazba je LIBOR3M za 3,7 % + 0,05 % se lhůtou 3 měsíce.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>
30	Množství	,1000000'	
31	Měna množství	,EUR'	

33	Cena	,0,05'	</AcctOwnr>
34	Měna, v níž je uvedena cena		</Buyr>
36	System	,XXXX'	<Sellr>
41	Identifikační kód nástroje		<AcctOwnr>
42	Úplný název nástroje	,BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15'	<Id>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	</Id>
46	Cenový multiplikátor	,1'	</AcctOwnr>
47	Kód podkladového nástroje	,+',DE000BAY0017'	</Sellr>
48	Název podkladového indexu	,-',LIBO'	...
49	Doba trvání podkladového indexu	,3'MNTH'	<Tx>
55	Datum konce platnosti	,2018-12-31'	...
56	Druh dodání	,CASH'	<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>

			<pre> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Upozorňujeme, že pole 30 Množství obsahuje nominální hodnotu nahlášeného obchodu se swapovou smlouvou. Pole 46 Cenový multiplikátor obsahuje počet swapových smluv obchodovaných při obchodu. Pole 33 Cena obsahuje případný spread zaplacený/přijatý k podkladové úrokové sazbě.

Znaménko „+“ před kódem podkladového nástroje znamená, že kupující přijímá plnění BAYER AG NA.

Znaménko „-“ před názvem podkladového indexu znamená, že kupující platí úrokovou sazbu.

5.35.7.2 Akciový swap (dvě akciové komponenty) obchodovaný na obchodní platformě mimo Unii (nástroj není k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 107

Investiční podnik X kupuje akciový swap na obchodní platformě mimo Unii, a proto není swap k dispozici na seznamu ESMA. Podkladové akciové indexy obsahují finanční nástroje, které jsou přijaté k obchodování na regulovaném trhu.

Obchodní platforma používá CCP s LEI CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Kód ISIN swapové smlouvy je US000DAX000X a nominální částka podléhající swapové dohodě je 1 000 000 EUR.

Konec platnosti smlouvy je dne 25. června 2016 a vypořádává se v hotovosti.

Jedním z podkladových nástrojů je index DAX 30 (ISIN DE0008469008).

Další podkladovým nástrojem je index IBEX 35 (ISIN ES0SI0000005).

Swapová smlouva má rozpětí „0“ a oba investiční podniky se dohodly, že podnik X zaplatí podniku Y předem částku 1000 EUR.

Kód systému pro akciový swap je XUSA a systém využívá ústřední protistranu s LEI CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Úplný název nástroje je volné textové pole, které vyplní subjekt provádějící obchod: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16.

Kód CFI pro akciový swap je SEIPXC.

Investiční podnik X obdrží plnění DAX a zaplatí plnění IBEX.

Jak hlásí Investiční podniky X a Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} ústřední protistrany
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} ústřední protistrany	{LEI} Investičního podniku Y
30	Množství	,1000000'	,1000000'
31	Měna množství	,EUR'	,EUR'
33	Cena	,0'	,0'
34	Měna, v níž je uvedena cena		
36	Systém	,XUSA'	,XUSA'
38	Platba předem	,1000'	,1000'
39	Měna platby předem	,EUR'	,EUR'
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN}	{ISIN}
42	Úplný název nástroje	,DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'	,DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'
43	Klasifikace nástroje	,SEIPXC'	,SEIPXC'
44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	,EUR'
46	Cenový multiplikátor	,1'	,1'
47	Kód podkladového nástroje	,+',{DAX 30 ISIN} ,-',{IBEX 35 ISIN}	,+',{DAX 30 ISIN} ,-',{IBEX 35 ISIN}
48	Název podkladového indexu	,+',{DAX 30' ,-',{IBEX 35'	,+',{DAX 30' ,-',{IBEX 35'
55	Datum konce platnosti	,2016-06-25'	,2016-06-25'
56	Druh dodání	,CASH'	,CASH'

Znázornění XML:

Hlášení Investičního podniku X	Hlášení Investičního podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>

<pre> <Id> <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>SEIPXC</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> </pre>	<pre> </Buyr> <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>SEIPXC</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> </pre>
--	---

<pre> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlyInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlyInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Nebo může Investiční podnik Y také předložit hlášení, ve kterém se uvede jako kupující namísto Investičního podniku X. V takovém případě je nutno příslušným způsobem změnit znaménka v poli podkladového nástroje, tj. aby ukazovala, který podkladový nástroj (jeho plnění) kupující obdrží, a který musí zaplatit.

5.35.7.3 Akciový swap (dvě akciové komponenty) obchodovaný mimoburzovně (nástroj není k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 108

Investiční podnik X obchoduje mimoburzovní akciový swap s Investičním podnikem Y. Podkladové akcie jsou přijaté k obchodování v obchodním systému. Konec platnosti smlouvy je dne 25. června 2016 a vypořádává se v hotovosti. Nominální hodnota podléhající swapové smlouvě je 1 000 000 EUR. Neplatí se žádné rozpětí.

Jednou podkladovou akcií je Orange (ISIN FR0000133308).

Druhou podkladovou akcií je Telefonica (ISIN ES0178430E18).

Úplný název nástroje je volné textové pole, které vyplní subjekt provádějící obchod: ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16. Kód CFI pro akciový swap je SESPXC.

Investiční podnik X obdrží plnění akcie Orange a zaplatí plnění akcie Telefonica.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<New> ...
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>

30	Množství	,1000000'	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <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>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> <Swpln> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </pre>
31	Měna množství	,EUR'	
33	Cena	,0'	
34	Měna, v níž je uvedena cena		
36	Systém	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	
46	Cenový multiplikátor	,1'	
47	Kód podkladového nástroje	,+'{ISIN podkladové akcie Orange} ,-'{ISIN podkladové akcie Telefonica}	
55	Datum konce platnosti	,2016-06-25'	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Jak hlásí Investiční podnik Y?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y	Znárodnění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku Y	<Tx> ... <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr>
30	Množství	,1000000'	</Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty>
33	Cena		<Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric>
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
36	Systém	,XXXX'	<FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN
41	Identifikační kód nástroje		16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
42	Úplný název nástroje	,ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	</FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	
47	Kód podkladového nástroje	,+',{ISIN podkladové akcie Orange},-',{ISIN podkladové akcie Telefonica}'	
55	Datum konce platnosti	,2016-06-25'	
56	Druh dodání	,CASH'	

			<pre> <Swpln> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

Nebo může Investiční podnik Y také předložit hlášení, ve kterém se uvede jako kupující namísto Investičního podniku X. V takovém případě je nutno příslušným způsobem změnit znaménka v poli podkladového nástroje, tj. aby ukazovala, který podkladový nástroj (jeho plnění) kupující obdrží, a který musí zaplatit.

5.35.7.4 Swap veškerých výnosů obchodovaný mimoburzovně (nástroj není k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 109

Investiční podnik X obchoduje mimoburzovně swap veškerých výnosů v Austrian Traded Index (ATX) s Investičním podnikem Y. Kód ISIN ATX je AT0000999982. Investiční podnik X zaplatí stanovenou sazbu definovanou jako EURIBOR 3M plus 30 bazických bodů, zatímco Investiční podnik Y zaplatí celkové výnosy indexu, včetně výnosu, který vytvoří, a všech kapitálových zisků. Investiční podnik Y prodává swap veškerých výnosů, zatímco Investiční podnik X kupuje swapovou smlouvu, protože Investiční podnik X využívá výnosy z podkladového aktiva bez toho, aby je fyzicky vlastnil, výměnou za stanovenou platbu.

Smlouva má nominální částku 2 000 000 EUR a její platnost skončí dne 15. prosince 2018.

Existuje dohodnutá platba předem 15 000 EUR, kterou Investiční podnik X zaplatí Y. Kód CFI je SEITXC a smlouva se vypořádává v hotovosti.

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Hodnoty hlášení Investiční podnik Y
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku Y
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	{LEI} Investičního podniku Y

30	Množství	,2000000'	,2000000'
33	Cena	,30'	,30'
34	Měna, v níž je uvedena cena		
36	Systém	,XXXX'	,XXXX'
38	Platba předem	,15000'	,15000'
39	Měna platby předem	,EUR'	,EUR'
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS'	,TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI + 30BPS'
43	Klasifikace nástroje	'SEITXC'	'SEITXC'
44	Jmenovitá měna	,EUR'	,EUR'
46	Cenový multiplikátor	,1'	,1'
47	Kód podkladového nástroje	,+ '{ISIN podkladového indexu ATX}'	,+ '{ISIN podkladového indexu ATX}'
48	Název podkladového indexu	,-' {Název indexu EURI}'	,-' {Název indexu EURI}'
49	Doba trvání podkladového indexu	,3MNTH'	,3MNTH'
55	Datum konce platnosti	,2018-12-15'	,2018-12-15'
56	Druh dodání	,CASH'	,CASH'

Znázornění XML:

Hlášení podniku X	Hlášení podniku Y
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN O PQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN O PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> </pre>

<pre> </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> <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> <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> <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 Swap koše akcií obchodovaný mimoburzovně (nástroj není k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 110

Investiční podnik X („plátce částky akcií“) uzavře dvouletý mimoburzovní swap koše akcií vypořádávaný v hotovosti dne 15. června 2018 s Investičním podnikem Y („plátce pevné sazby“) s LIBOR 1 rok ve výši 3,7 % + 5 bazických bodů. Investiční podnik X souhlasí, že uhradí při splatnosti celkové plnění koše akcií čtyř společností (počáteční hodnota koše: 21,85 EUR) investiční společnosti Y. Počet akcií podléhajících swapové smlouvě je 1 000 000, což znamená nominální hodnotu akciového swapu 21 850 000 EUR.

Koš tvoří čtyři akcie, z nichž tři jsou obchodované v obchodním systému Evropského hospodářského prostoru:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)
- Cargotec (ISIN FI0009013429)
- Intel Corporation (ISIN US4581401001)

Podle čl. 26 odst. 2 písm. c) nařízení MiFIR se americká akcie v koši nebude vyplňovat v poli 47 (Kód podkladového nástroje), protože se neobchoduje v obchodním systému Evropského hospodářského prostoru.

Datum konce platnosti smlouvy je 15. června 2018 a kód CFI je SEBPXC. Smlouva se vypořádává v hotovosti.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku Y	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	y> ...
30	Množství	‚21850000‘	<Buyr>
31	Měna množství	‚EUR‘	<AcctOwnr>
33	Cena	‚5‘	<Id>
34	Měna, v níž je uvedena cena		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
36	Systém	‚XXXX‘	</Id>
41	Identifikační kód nástroje		</AcctOwnr>
42	Úplný název nástroje	‚KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018‘	</Buyr> <Sellr>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>

44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	</Id>
46	Cenový multiplikátor	,1'	</AcctOwnr>
47	Kód podkladového nástroje	,+',F10009005870' ,+',F10009014575' ,+',F10009013429'	</Sellr> ... <Tx> ...
48	Název podkladového indexu	,-',LIBO'	<Qty> <NmnlVal
49	Doba trvání podkladového indexu	,1YEAR'	Ccy="EUR">218550000</NmnlVal>
55	Datum konce platnosti	,2018-06-15'	</Qty> <Pric>
56	Druh dodání	,CASH'	<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> <SwpIn> <Bskt> <ISIN>F10009005870</ISIN> <ISIN>F10009014575</ISIN> <ISIN>F10009013429</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>
--	--	--	--

V tomto případě Investiční podnik Y kupuje tento swap koše akcií, protože tento podnik, Investiční podnik Y, přijímá plnění tohoto koše akcií.

5.35.7.6 Swap dvou košů akcií mimoburzovně (nástroj není k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 111

Investiční podnik X („plátce plnění koše A“) uzavře dvouletý mimoburzovní swap koše akcií s vypořádáním v hotovosti dne 15. července 2018 s Investičním podnikem Y („plátce plnění koše B“). Investiční podnik X souhlasí, že při splatnosti zaplatí celkové plnění koše akcií A a Investiční podnik Y souhlasí, že při splatnosti zaplatí celkové plnění koše akcií B. Nominální hodnota akciového swapu je 10 000 000 EUR.

Akciový koš A obsahuje dvě akcie (které se obchodují v obchodním systému a má referenční hodnotu 16,10 EUR:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)

Akciový koš B tvoří dvě akcie (které se obchodují v obchodním systému) a má referenční hodnotu 40,85 SEK:

- Elisa (ISIN FI0009007884)
- TeliaSonera (ISIN SE0000667925)

Datum konce platnosti swapové smlouvy je 15. července 2018 a příslušný kód CFI je SEBPXC.

Swapová smlouva má rozpětí „0“.

Hlášení o obchodech zobrazená níže jsou pouze z pohledu Investičního podniku X.

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podniku X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPt
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	y> ...
30	Množství	,10000000'	<Buyr>
31	Měna množství	,EUR'	<AcctOwnr>
33	Cena	,0'	<Id>

34	Měna, v níž je uvedena cena		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
36	Systém	,XXXX'	</Id>
41	Identifikační kód nástroje		</AcctOwnr>
42	Úplný název nástroje	,RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018'	</Buyr>
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	<Sellr>
44	Jmenovitá měna 1	,EUR'	<AcctOwnr>
46	Cenový multiplikátor	,1'	<Id>
47	Kód podkladového nástroje	,+',FI0009007884' ,+',SE0000667925' ,-',FI0009005870' ,-',FI0009014575'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
55	Datum konce platnosti	,2018-07-15'	</Id>
56	Druh dodání	,CASH'	</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>
			<NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<XpryDt>2018-07-25</XpryDt>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Swp>
			<SwpIn>
			<Bskt>
			<ISIN>FI0009007884</ISIN>
			<ISIN>SE0000667925</ISIN>
			</Bskt>
			</SwpIn>
			<SwpOut>
			<Bskt>
			<ISIN>FI0009005870</ISIN>
			<ISIN>FI0009014575</ISIN>
			</Bskt>
			</SwpOut>
			</Swp>
			</UndrlygInstrm>
			<DlvryTp>CASH</DlvryTp>
			</DerivInstrmAttrbts>
			</Othr>

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

Pokud by Investiční podnik Y předložil hlášení, ve kterém se uvede jako kupující namísto Investičního podniku X, bylo by nutno příslušným způsobem změnit znaménka v poli podkladového nástroje, tj. aby ukazovala, který podkladový nástroj (jeho plnění) kupující obdrží, a který musí zaplatit.

5.35.7.7 Standardní úrokový swap obchodovaný v obchodním systému (nástroj k dispozici v seznamu ESMA)

Příklad 112

Investiční podnik X kupuje standardní úrokový swap (ISIN XS0000000003) od Investičního podniku Y za nominální částku 100 000 000 GBP v Obchodním systému M. Datum konce platnosti swapu je 21. října 2025. Pro zjednodušení předpokládáme, že swapová smlouva má nulové rozpětí.

Investiční podnik X zaplatí 1,8655 %, půlročně (Act/365F), zatímco Investiční podnik Y platí 6měsíční GBP-LIBOR, půlročně (Act/365F).

Swapová smlouva má rozpětí „0“.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} Investičního podniku X	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku Y	...
30	Množství	‚100000000‘	<Buyr>
31	Měna množství	‚GBP‘	<AcctOwnr>
33	Cena	‚0‘	<Id>
34	Měna, v níž je uvedena cena		<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>
36	Systém	Segment {MIC} Obchodního systému M	</AcctOwnr> </Buyr>
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} nástroje	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>

			<pre> <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> </pre>
--	--	--	---

Cena vyplněná v poli 33 musí být konzistentní s hodnotou pevné sazby v referenčních údajích o nástroji.

5.35.8 Komoditní deriváty

5.35.8.1 Mimoburzovní opce na futures na komodity obchodované v obchodním systému

Příklad 113

Investiční podnik X kupuje 100 up-and-in amerických bariérových kupních opčních smluv na futures na kukuřici. Realizační cena je 168 EUR a datum konce platnosti je 30. srpna 2018. Jedna opční smlouva opravňuje kupujícího k jedné futures na kukuřici.

Vyplacená prémie je 0,95 EUR.

Podkladovým nástrojem bariérové opční smlouvy jsou futures obchodované na Euronext Paris za 170 EUR. Jednotka obchodování u futures na kukuřici je 50 tun a kód ISIN smlouvy je FR0000000000.

Bariéra je umístěna na 172 EUR (opční smlouva vstoupí v účinnost pouze v případě, kdy cena podkladových futures dosáhne bariéry).

Kód CFI bariérové opce je HTFBBC a kontrakt je vypořádán v hotovosti.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podniku X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
30	Množství	,100'	
33	Cena	,0,95'	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> </pre>
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	<pre> ... </pre>

36	Systém	,XXXX'	<pre> <Tx> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <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> <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>
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORNFUTURES CONTRACT'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,1'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} future na kukuřici	
50	Typ opce	,CALL'	
51	Realizační cena	,168'	
52	Měna realizační ceny	,EUR'	
53	Realizace opce	,AMER'	
55	Datum konce platnosti	,2018-08-30'	
56	Druh dodání	,CASH'	

Podkladovým nástrojem u bariérové opce je futures na kukuřici, a proto se do pole 47 vyplní identifikační kód Euronext pro futures na kukuřici.

Pole referenčních údajů o nástroji v hlášení o obchodu popisují bariérovou opci.

5.35.8.2 Smlouva na emisní povolenky

Příklad 114

Investiční podnik X kupuje 3 000 emisních povolenek EU za 7,50 EUR na regulovaném trhu European Energy Exchange (MIC XEEE).

ISIN nástroje je DE000A1DKQ99.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
30	Množství	,3000'	
33	Cena	,7,50'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	...
36	Systém	Segment {MIC} obchodního systému	<Tx> ...
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} smlouvy na emisní povolenky	<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>

5.35.8.3 Futures na emisní povolenky

Příklad 115

Investiční podnik X kupuje 5 futures na emisní povolenky EU (1 futures představuje 1000 povolenek EU na CO2) za 7,90 EUR na regulovaném trhu European Energy Exchange (MIC XEEE).

Kód ISIN futures na emisní povolenky je DE000A0SYVA6.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	<Tx> <New> ...
30	Množství	,5'	
33	Cena	,7,90'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	...
36	Systém	Segment {MIC} obchodního systému	<Tx> ...
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN} futures	<Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.90</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A0SYVA6</Id> </FinInstrm> ...
			</New> </Tx>

5.35.8.4 Mimoburzovní opce na futures na emisní povolenky obchodované v obchodním systému

Příklad 116

Investiční podnik X kupuje 5 mimoburzovních kupních opčních smluv evropského stylu na futures na emisní povolenky obchodované v obchodním systému. Vyplacená prémie je 1,00 EUR a konec platnosti opční smlouvy je 31. prosince 2018. Tato opce není obchodovaná v obchodním systému ani nemá kód ISIN.

Cenový multiplikátor (počet futures v jedné smlouvě) je 10, realizační cena (cena, za kterou se futures kupují nebo prodávají, když je opce uplatněna) je 8,00 EUR.

Futures na emisní povolenky se obchodují na regulovaném trhu European Energy Exchange (MIC XEEE) a kód ISIN je DE000A0SYVA6.

Kód CFI pro kupní opci je HTFAVC a smlouva se vypořádává v hotovosti.

Jak hlásí Investiční podnik X?

Č.	Pole	Hodnoty hlášení Investiční podnik X	Znázornění XML
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	
30	Množství	,5'	
33	Cena	,1,00'	
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	
36	System	,XXXX'	
41	Identifikační kód nástroje		
42	Úplný název nástroje	,XXX CALL OPTION'	
43	Klasifikace nástroje	{Kód CFI}	
46	Cenový multiplikátor	,10'	
47	Kód podkladového nástroje	{ISIN} podkladových futures	
50	Typ opce	,CALL'	
51	Realizační cena	,8,00'	
52	Měna realizační ceny	,EUR'	
53	Realizace opce	,EURO'	
55	Datum konce platnosti	,2018-12-31'	

56	Druh dodání	,CASH'	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</Ex ctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>XXX CALL OPTION</FullNm> <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> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </pre>
----	-------------	--------	--

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

Podkladovým nástrojem u kupní opce je futures na emisní povolenky, a proto se do pole 47 vyplní ISIN těchto futures.

5.35.9 Komplexní obchody

Článek 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 platí pouze v případě, kdy investiční podnik provádí obchod, který se týká dvou nebo více finančních nástrojů (tj. komplexní obchod). To znamená, že pro účely hlášení obchodů se u obchodu musí mít za to, že zahrnuje dva nebo více finančních nástrojů, pokud dojde k jednotnému obchodu s více finančními nástroji současně za jednotnou cenu (např. nákup jedné „short butterfly smlouvy“, tvořené různými kupními opcemi). Do všech polí nezobrazených v příkladu se musí vyplnit komplexní obchod (např. strategie a strukturované produkty), nikoli aktuální komponenty.

Příklad 117

Investiční podnik X chce vytvořit strategii short butterfly, tvořenou dvěma prodeji kupní opce na 1 075 finančních nástrojů a jedním nákupem kupní opce na 2 150 finančních nástrojů. Zadá pokyn ke dvěma prodejům a jednomu nákupu do obchodního systému Eurex, kde je proveden jako obchod s jednou strategií a s jednotnou cenou.

Č.	Pole	Hodnoty Hlášení č. 1	Hodnoty Hlášení č. 2	Hodnoty Hlášení č. 3
2	Referenční číslo obchodu	89127	89128	89129
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany	{LEI} Podniku X	{LEI} ústřední protistrany
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} ústřední protistrany	{LEI} Investičního podniku X
30	Množství	,1075'	,2150'	,1075'
33	Cena	,40'	,40'	,40'
36	Systém	Segment {MIC} obchodního systému	Segment {MIC} obchodního systému	Segment {MIC} obchodního systému
40	ID komplexních obchodních složek	,12345'	,12345'	,12345'

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 2	Hlášení č. 3
<pre><Tx> <New> <TxId>89127</TxId> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>89128</TxId> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>89129</TxId> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr></pre>

<pre> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <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> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <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> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <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>
--	---	--

Příklad 118

Investiční podnik X prodá 10 futures na dluhopisy na Eurex Bonds (XEUR) a současně koupí odpovídající počet podkladových německých vládních dluhopisů. Tyto komponenty obchodu jsou součástí strategického obchodu (basis trade) a obchodované za jednotnou cenu 20 EUR.

Kód ISIN pro futures na dluhopisy je DE0000000000 a kód ISIN podkladového dluhopisu je DE0000000001.

Tento obchod se hlásí ve dvou samostatných hlášeních o obchodech, z nichž každé odráží obchod s jedním z finančních nástrojů, které tvoří strategii. Obě hlášení o obchodech musí být propojena

interním kódem, který se vyplní v poli 40 a který je jedinečný pro hlášení o obchodech týkající se stejné strategie.

Hlášení o obchodech zobrazená níže jsou pouze z pohledu Investičního podniku X.

Č.	Pole	Hodnoty hlášení č. 1	Hodnoty hlášení č. 2
4	Identifikační kód subjektu provádějícího obchod	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} Investičního podniku X
7	Identifikační kód kupujícího	{LEI} ústřední protistrany	{LEI} Investičního podniku X
16	Identifikační kód prodávajícího	{LEI} Investičního podniku X	{LEI} ústřední protistrany
30	Množství	,10'	,1000000'
33	Cena	,20'	,20'
34	Měna, v níž je uvedena cena	,EUR'	,EUR'
36	System	Segment {MIC} obchodního systému	Segment {MIC} obchodního systému
40	ID komplexních obchodních složek	,12345'	,12345'
41	Identifikační kód nástroje	{ISIN futures na dluhopisy}	{ISIN dluhopisů}

Znázornění XML:

Hlášení č. 1	Hlášení č. 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> </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> </pre>

<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpnt Id> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000000</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpnt Id> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000001</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

6 Obecné pokyny k vedení záznamů o pokynech

Část I – Obecné zásady

6.1 Oblast působnosti požadavků na vedení záznamů o pokynech

V souladu s čl. 25 odst. 2 se požadavky na vedení záznamů o pokynech vztahují na organizátory obchodních systémů, pokud jde o „všechny pokyny pro finanční nástroje sdělované prostřednictvím jejich systémů“.

Vztahují se na „pokyny“, což zahrnuje pokyny aktivní, neaktivní, pozastavené, implicitní a přesměrované, i změny, zrušení nebo zamítnutí pokynů. Rovněž se vztahují na pevné a indikativní kotace.

6.2 Členové nebo účastníci obchodního systému

Ve směrnici MiFID II a nařízení MiFIR je několik ustanovení, která odkazují na „člena nebo účastníka“ obchodního systému. Co se rozumí pojmem „obchodní systém“, je definováno v čl. 4 odst. 1 bodě 24 směrnice MiFID II a podchycuje regulované trhy, mnohostranné obchodní systémy (MTF) a organizované obchodní systémy (OTF). Je však třeba dále objasnit, co se myslí „členem nebo účastníkem“ obchodního systému pro účely článku 50 směrnice MiFID II a čl. 25 odst. 2 nařízení MiFIR.

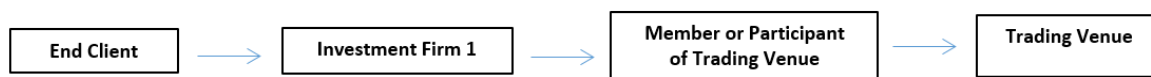
Pojmy „člen“ a „účastník“ se obvykle používají v rámci regulovaných trhů a mnohostranných obchodních systémů. Bod odůvodnění 16 směrnice MiFID II objasňuje, že „osoby mající přístup na regulované trhy nebo k mnohostranným obchodním systémům se označují jako členové nebo účastníci. Oba pojmy jsou zaměnitelné...“

Pro OTF se však používá odlišná metodika, která odráží skutečnost, že povinnosti ve vztahu k zákazníkům v MiFID se vztahují na organizátory OTF na rozdíl od MTF a RM. Ustanovení čl. 18 odst. 7 směrnice MiFID II například uvádí, že MTF a OTF musí mít „alespoň tři fyzicky působící členy či uživatele“, kdežto článek 20 obsahuje zákaz, aby OTF prováděly pokyny „zákazníků“ za použití vlastního kapitálu OTF. V obou případech se zdá, že pojem „uživatel“ a „zákazník“ jsou zaměnitelné, pokud odkazují na OTF, a že v důsledku toho jsou analogické s pojmy „člen“ nebo „účastník“.

Vzhledem k tomu, že OTF jsou zahrnuty v oblasti působnosti nařízení o zneužívání trhu a vzhledem k potřebě uplatnit požadavky MiFID II/MiFIR konzistentně u různých typů obchodních systémů, bude proto platit, že pojmy „člen nebo účastník“ v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 (vedení záznamů o pokynech) a nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 (synchronizace obchodních hodin) zahrnují zákazníky nebo uživatele OTF.

6.3 Identifikační kód zákazníka (pole 3)

Identifikační kód zákazníka (pole 3) se používá k identifikaci zákazníka člena nebo účastníka. Do pole 3 se vyplní pouze LEI, případně {NATIONAL_ID} bezprostředního zákazníka člena nebo účastníka obchodního systému. Povinnost vést identifikační kód zákazníka (pole 3) nevyžaduje od obchodních systémů, aby zaznamenávaly zákaznické ID koncového zákazníka, ani žádné jiné zákaznické ID zprostředkovatelů v řetězci od bezprostředního zákazníka člena nebo účastníka ke koncovému zákazníkovi. Následující vývojový diagram ilustruje výše uvedené vysvětlení: zákazníkem člena nebo účastníka obchodního systému je Investiční podnik 1.



End client	Koncový zákazník
Investment Firm 1	Investiční podnik 1
Member of Participant of Trading Venue	Člen nebo účastník obchodního systému
Trading Venue	Obchodní systém

Organizátoři obchodních systémů si vyžádají zákaznický identifikační kód bezprostředního zákazníka od svého člena nebo účastníka a vyplní toto zákaznické ID do pole 3.

V případě, že není zákaznické ID získáno v době, kdy je organizátoru obchodního systému zadán pokyn, organizátor získá scházející zákaznické ID co nejdříve, nejpozději do konce pracovního dne po zadání pokynu.

U zákazníků zkontroluje obchodní systém, zda uvedený identifikační kód neobsahuje zjevné chyby nebo opomenutí.

6.3.1 Vyplnění pole 3 (Identifikační kód zákazníka) v případě sdružených pokynů

Pokud došlo k alokaci a zákazníci jsou identifikováni před předáním pokynu členu nebo účastníkovi obchodního systému k provedení, ale pokyny několika zákazníků jsou sdruženy členem nebo účastníkem obchodního systému, musí organizátor obchodního systému vyplnit do pole 3 defaultní referenci „AGGR“.

6.3.2 Vyplnění pole 3 (Identifikační kód zákazníka) v případě neprovedených alokací

Pokud nastane výjimečný případ, že alokace nebyla v čase zadání pokynu provedena a pokud platné vnitrostátní právní předpisy umožňují, aby k alokaci pokynu došlo až po jeho zadání, musí organizátor obchodního systému u takového pokynu vyplnit v poli 3 defaultní referenci „PNAL“. Příslušný organizátor obchodního systému nemusí následně zjišťovat zákaznické ID v okamžiku alokace pokynů jednotlivým zákazníkům.

6.4 Makléř neprovádějící pokyny (pole 6)

Činnost makléře neprovádějícího pokyny se liší od přímého elektronického přístupu (DEA) definovaného podle čl. 4 odst. 1 bodu 41 směrnice MiFID II. Ustanovení čl. 2 odst. 1 písm. d) nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 společně s polem 6 uvádí, že tato služba vzniká, když člen nebo účastník obchodního systému (makléř neprovádějící pokyny) směřuje pokyn do obchodního systému jménem a na účet jiného člena nebo účastníka obchodního systému.

Příklad 119

Investiční podnik X zadává pokyn k provedení do Obchodního systému M prostřednictvím makléře neprovádějícího pokyny, Investičního podniku Y, na účet Zákazníka Z.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	{LEI} Investičního podniku X, který je členem Obchodního systému M	
2	Přímý elektronický přístup (DEA)	FALSE	
3	Identifikační kód zákazníka	{NATIONAL_ID} fyzické osoby Z	
6	Makléř neprovádějící pokyny	{LEI} Investičního podniku Y	
Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity			
7	Postavení	AOTC	Investiční podnik X jedná na účet Zákazníka Z

6.5 Stav pokynu (pole 33)

Stav pokynu musí být prázdný u událostí zrušení, zamítnutí, konce platnosti a úplného provedení, protože již nejsou uloženy v knize pokynů obchodního systému.

6.6 Datum a čas doby platnosti (pole 12)

- i. Pokud jde o pokyny „ihned nebo zruš“ (IOC) a „splň nebo zruš“ (FOK), mělo by pole 12 (Datum a čas doby platnosti) zůstat u pokynů „ihned nebo zruš“ a „splň nebo zruš“ prázdná (viz pole 10 – Doba platnosti). Důvodem je to, že tyto typy pokynů jsou určeny k provedení okamžitě při zadání do knihy pokynů (buď zcela, v případě pokynů FOK, nebo v maximálním možném množství, v případě pokynů IOC).
- ii. Pokud jde o kategorii „Jiné“, odkaz na datová a časová razítka u „jiných“ typů doby platnosti znamená jakýkoli jiný typ doby platnosti, který není specificky uveden v poli 10 (Doba platnosti). V tom případě se v poli 10 vyplní jedinečný čtyřpísmenný kód, který zastupuje tento specifický typ doby platnosti, a pole 12 se vyplní.

6.7 Indikátor pasivního nebo agresivního pokynu (pole 44)

Toto pole se vyplní pouze při provádění, k němuž dochází během kontinuálního obchodování, jinak zůstane prázdná. Důvodem je to, že pokyn během aukčních období nebude pasivní ani agresivní.

6.8 Identifikační kód obchodů v obchodním systému (TVTIC) (pole 48)

Podle článku 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 udržují organizátoři obchodních systémů individuální „identifikační kód obchodů v obchodním systému“ (TVTIC) pro každý obchod, který je výsledkem úplného nebo částečného provedení pokynu, jak uvádí pole 48.

V důsledku toho organizátoři obchodního systému vždy vygenerují „identifikační kód obchodů v obchodním systému“ (TVTIC) pro každý obchod provedený v jejich obchodním systému, který vychází z pokynu pro finanční nástroj sdělovaný prostřednictvím jejich systémů. Za výše uvedených okolností nahlásí organizátor obchodního systému odpovídajícím způsobem relevantní TVTIC vyplněním pole 48.

6.9 Pořadové číslo (pole 15)

Pořadové číslo se používá k určení, ke které události došlo v obchodním systému jako první, pokud mají dvě události stejné časové razítko. Obchodní systémy zajistí, aby každé ze specifických událostí, které jsou uvedeny v poli 21 ve sloupcích obsah a formát, bylo přiděleno pořadové číslo. Fáze obchodování uvedené v oddíle 6.13.9 se podchycují událostí „změna stavu v důsledku tržních operací“ uvedenou v poli 21. Proto obchodní systémy vyplní pořadové číslo změn ve fázích obchodování.

Některé obchodní systémy mohou pracovat s více systémy párování, aby se vyrovnala zátěž v jejich systémech. V takovém případě bude pořadové číslo každé události jedinečné a konzistentní u všech událostí v daném systému párování.

Uvádíme následující příklady:

- a. Nesprávné použití, kdy pořadové číslo je specifické pouze pro jednu knihu pokynů
- b. Nesprávné použití, kdy je patrné, že pořadové číslo je jedinečné pro každý pokyn
- c. Správné použití pořadového čísla

U příkladů 77 a 78 uvedených níže obsahuje jednotný systém obchodního systému párování více než jednu knihu pokynů a v obou knihách pokynů dochází k více událostem.

Příklad 120: Nesprávné použití, kdy pořadové číslo je specifické pouze pro jednu knihu pokynů

Zde je patrné, že pořadové číslo je specifické pouze pro jednu knihu pokynů. To není přípustné, protože to znamená, že příslušné orgány by nebyly schopny konsolidovat události, ke kterým by došlo v několika knihách pokynů ve stejném systému párování. Například: konsolidování událostí u stejného finančního nástroje v transparentních a anonymních knihách.

Správná pořadová čísla jsou 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7.

Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné nebo úplné provedení (pole 21)	Kód knihy pokynů (pole 17)	Identifikační kód pokynu (pole 20)	Pořadové číslo (pole 15)	Datum a čas
NEWO	Kniha pokynů 1	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z
NEWO	Kniha pokynů 2	GHI	1	2018-03-07T08:30:26.548936Z
CHME	Kniha pokynů 1	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z
NEWO	Kniha pokynů 2	TUV	2	2018-03-07T08:30:26.598731Z
NEWO	Kniha pokynů 1	DEF	3	2018-03-07T08:30:26.975621Z
CAME	Kniha pokynů 1	ABC	4	2018-03-07T08:30:27.025489Z
CAME	Kniha pokynů 1	DEF	5	2018-03-07T08:30:27.025489Z

Příklad 121: Nesprávné použití, kdy je patrné, že pořadové číslo je jedinečné pro každý pokyn

Zde je patrné, že pořadové číslo je jedinečné pro každý pokyn, nikoli v rámci celého systému párování.

Správná pořadová čísla jsou 1, 2, 3, 4, 5.

Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné nebo úplné provedení (pole 21)	Identifikační kód pokynu (pole 20)	Pořadové číslo (pole 15)	Datum a čas (pole 9)	Poznámka
NEWO	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Pořadové číslo je specifické pouze pro pokyn, takže každá událost u daného pokynu zvyšuje pořadové číslo. To není správné, protože pořadové číslo každé události musí být jedinečné a konzistentní u všech událostí.
CHME	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z	
NEWO	DEF	1	2018-03-07T08:30:26.975621Z	Protože toto je jiný pokyn, pořadové číslo začíná znovu na jedna.
CAME	ABC	3	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	2	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Časové razítko je stejné jako u předchozí události. Kdyby však příslušné orgány seřadily pořadová čísla vzestupně, potom by to budilo dojem, že k této události došlo před událostí přímo nad ní, jenže tomu tak není.

Příklad 122: Správné použití pořadového čísla

V tomto příkladu se předpokládá, že ke všem událostem došlo ve stejné knize pokynů a že obchodní systém má jeden systém párování.

Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné nebo úplné provedení (pole 21)	Identifikační kód pokynu (pole 20)	Pořadové číslo (pole 15)	Datum a čas (pole 9)	Poznámka
NEWO	ABC	25897	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Pořadové číslo se generuje v rámci knih pokynů obchodního systému. Proto se při pohledu na události v jedné knize pokynů může pořadové číslo zvyšovat o více než 1.
CHME	ABC	26589	2018-03-07T08:30:26.598721Z	Pořadové číslo se zvýšilo o více než jednu, protože systém párování zpracoval další události v jiných knihách pokynů, ale stále jde o jedinečné, celé číslo ve vzestupném pořadí.
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	Časové razítko je stejné jako u předchozí události. Pořadové číslo však umožňuje příslušnému orgánu určit, že k této události došlo po události v řádku výše.

6.10 Doba platnosti (pole 10)

6.10.1 Příznak Good-For-Day (DAVY)

Příklad 123

Investiční podnik X zadává pokyn k provedení v Obchodním systému M s příznakem Good-For-Day (DAVY) dne 16. ledna 2018.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	DAVY
12	Datum a čas doby platnosti	2018-01-16T23:59:59.999999Z

6.10.2 Kombinace dvou příznaků doby platnosti: Good-After-Date (GADV) a Good-Till-Date (GTDV)

Příklad 124

Investiční podnik X zadává pokyn k provedení do Obchodního systému M s příznaky Good-After-Date (GADV) a Good-Till-Date (GTDV) dne 16. ledna 2018 v 10:05:32.278932(UTC). Při zadání bude doba platnosti GADV a datum a čas doby platnosti 19. ledna 2018 s časem zaznamenaným jako 00:00:00 (se zlomky sekund zaznamenanými podle článku 50 směrnice MiFID II) nebo pro začátek obchodování v daném obchodním systému (Událost 1). Dne 19. ledna 2018 bude doba platnosti GADV a datum a čas doby platnosti 13. února 2018 s časem zaznamenaným jako 23:59:59 (se zlomky sekund zaznamenanými podle článku 50 směrnice MiFID II) (Událost 2).

Událost 1: Zadání pokynu k provedení

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-16T10:05:32.278932Z
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	GADV
12	Datum a čas doby platnosti	2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁴
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	NEWO
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
33	Stav pokynu	INAC ³⁵

Událost 2: Pokyn se stává aktivním

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁶
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	GTDV

³⁴ Nebo vložte jakékoli jiné časové razítko před zahájením obchodování a/nebo úvodní aukcí.

³⁵ Při zadávání pokynu do obchodního systému je pokyn neaktivní vzhledem k době platnosti GADV.

³⁶ Nebo vložte jakékoli jiné časové razítko před zahájením obchodování a/nebo úvodní aukcí.

12	Datum a čas doby platnosti	2018-02-13T23:59:59.999999Z
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	CHMO ³⁷
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
33	Stav pokynu	ACTI

6.11 Poskytování likvidity (pole 8)

K poskytování likvidity členy nebo účastníky obchodních systémů obvykle dochází při jednom z následujících tří scénářů:

- člen nebo účastník se zapojuje do algoritmického obchodování za účelem uskutečňování strategie tvorby trhu a v důsledku toho uzavře dohodu s obchodním systémem podle článku 17 a článku 48 směrnice MiFID II;
- člen nebo účastník provádějící poskytování likvidity (nepodchycené jako strategie tvorby trhu podle článku 17 směrnice MiFID II) obchoduje na vlastní účet na základě dohody s emitentem nebo obchodním systémem;
- člen nebo účastník provádějící poskytování likvidity provádí pokyny na účet zákazníků na základě dohody s emitentem nebo obchodním systémem.

Poskytování likvidity uvedené pod písmeny a) až c) se musí odrážet v záznamech obchodního systému prostřednictvím vhodně vyplněného pole 7 (Postavení), pole 8 (Poskytování likvidity) a pole 3 (Identifikační kód zákazníka), pokud provádí pokyny na účet zákazníků.

Příklad 125

Scénář	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Činnost podle a)	Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity	
	7. Postavení	DEAL
	8. Poskytování likvidity	ano
Činnost podle b)	Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity	
	7. Postavení	DEAL
	8. Poskytování likvidity	ano
Činnost podle c)	Oddíl A – Identifikace příslušných stran	

³⁷ Aktivace pokynu je považována za změnu stavu vzhledem k operacím na trhu.

	3. Identifikační kód zákazníka	{LEI} nebo {NATIONAL_ID}
	Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity	
	7. Postavení	AOTC
	8. Poskytování likvidity	ano

Část II – Scénáře

6.12 Legenda

Není-li ve specifickém scénáři uvedeno jinak, platí pro všechny scénáře uvedené v části II následující souvislosti:

Investiční podnik X (LEI: 12345678901234567890) je členem nebo účastníkem Obchodního systému M.

Investiční podnik Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) je také členem nebo účastníkem Obchodního systému M.

Segment MIC Obchodního systému M je ‚XMIC‘.

Obchodní systém M má latenci mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu kratší než 1 milisekundu.

Kód ISIN finančního nástroje je: XX0000000000

Identifikační kód pokynu je: 123456789ABC

Kód knihy pokynů v Obchodním systému M je: XYZ9876

Vygenerovaný identifikační kód obchodů v obchodním systému pro Obchodní systém M je: ABC123456

Dále jsou všechna pole v tabulce polí nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 povinná. Pole se ponechají prázdná, pokud nejsou pro konkrétní událost relevantní. Například pole 14 Objemová priorita není relevantní pro knihu pokynů priority cena–čas a neočekává se jeho vyplnění. Obchodní případy se zaměřují pouze na pole, která vyžadují objasnění. Bez ohledu na technický formát, ve kterém jsou uvedena data (např. XML, CSV atd.), pokud může být dané pole ponecháno prázdné, informace se uvedou tak, aby příslušný orgán mohl identifikovat, že dané pole bylo ponecháno prázdné.

6.13 Central Limit Order Book

Obecné pokyny pro systém central limit order book zahrnují následující scénáře:

- a) Pododdíl 6.14.1: Nový pokyn / zrušení / změna pokynů
- b) Pododdíl 6.14.2: Další limitní cena
- c) Pododdíl 6.14.3: Klasifikace limitního pokynu Iceberg
- d) Pododdíl 6.14.4: Pokyny Peg (nebo Pegged)
- e) Pododdíl 6.14.5: Klasifikace pokynu Stop
- f) Pododdíl 6.14.6: Směřované pokyny
- g) Pododdíl 6.14.7: Klasifikace strategických pokynů
- h) Pododdíl 6.14.8: Změna priority
- i) Pododdíl 6.14.9: Fáze obchodování

6.13.1 Nový pokyn / zrušení / změna pokynů (pole 21)

6.13.1.1 Přijetí nového pokynu

I když je pokyn proveden při zadání do knihy pokynů, první událostí, která se hlásí, je „Nový pokyn“.

Příklad 126

Investiční podnik X zadá k provedení limitní příkaz k nákupu (nákup 1000 akcií finančního nástroje za 80,00 EUR) do Obchodního systému M dne 16. ledna 2018. Informace je přijata systémem párování obchodního podniku M v 08:05:32.278932(UTC).

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-16T08:05:32.278932Z
Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
16	Kód MIC segmentu	XMIC
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000
19	Datum přijetí	2018-01-16
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	NEWO
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	80,00
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		

32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	1000
37	Zbývajících a skrytých množství	1000
38	Zobrazované množství	1000
39	Obchodované množství	0

6.13.1.2 Změna pokynu členem nebo účastníkem

Příklad 127

Investiční podnik X zadá změnu ceny (změní na 81,00 EUR) u výše uvedeného pokynu do Obchodního systému M (nákup 1000 akcií ISIN XX0000000000 za 80,00 EUR) dne 16. ledna 2018. Žádost o změnu je přijata systémem párování Obchodního systému M v 14:47:55.179524(UTC). O změnu pokynu požádal zákazník Investičního podniku X.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-16T14:47:55.179524Z
Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	REME
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	81,00
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	1000
37	Zbývajících a skrytých množství	1000
38	Zobrazované množství	1000
39	Obchodované množství	0

6.13.1.3 Částečně provedený pokyn

Příklad 128

Změněný pokyn na 1000 akcií s ISIN XX0000000000 za 81,00 EUR (viz pododdíl výše) je částečně proveden (200 akcií s ISIN XX0000000000 za 81,00 EUR) ve stejný den, tj. 16. ledna 2018 ve 14:48:11.544378(UTC).

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-16T14:48:11.544378Z
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		

20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	PARF
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	81,00
28	Cena obchodu	81,00
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	1000
37	Zbývajících množství	800
38	Zobrazované množství	800
39	Obchodované množství	200
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	ABC123456

6.13.1.4 Zcela provedený pokyn

Příklad 129

Částečně provedený pokyn na zbývajících množství 800 akcií s ISIN XX0000000000 za 81,00 EUR (viz pododdíl výše) je poté zcela proveden (800 akcií s ISIN XX0000000000 za 81,00 EUR) ve stejný den, tj. 16. ledna 2018 ve 14: 50:20.379545(UTC).

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-16T14: 50:20.379545Z
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	FILL
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	81,00
28	Cena obchodu	81,00
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	1000
37	Zbývajících množství	0
38	Zobrazované množství	0
39	Obchodované množství	800
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	ABC789000

6.13.1.5 Zrušení pokynu

Příklad 130

Investiční podnik X zadá žádost o zrušení pokynu k prodeji 2 000 akcií s ISIN XX0000000000 za 50,00 EUR do Obchodního systému M dne 18. ledna 2018 ve 14:12:34(UTC). Žádost o zrušení je přijata systémem párování Obchodního systému M ve 14:12:34.112856(UTC). O zrušení pokynu požádal zákazník Investičního podniku X.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-01-18T14:12:34.112856Z
Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	987654321ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	CAME
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	50,00
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL
33	Stav pokynu ³⁸	
36	Původní množství	2000
37	Zbývajících množství	0
38	Zobrazované množství	0
39	Obchodované množství	0

6.13.2 Další limitní cena (pole 25)

Příklad 131

Obchodní systém M nabízí během závěrečné aukce funkci, kdy lze zadat limitní pokyn s limitní cenou, která je maximální cenou pro nákup nebo minimální cenou pro prodej, a možnou další limitní cenou, která je minimální cenou pro nákup nebo maximální cenou pro prodej. V Obchodním systému M se bude tento typ pokynu považovat za aktivní, bez ohledu na to, zda cena cenného papíru je mimo minimální a maximální cenu. Pokyn k nákupu je zadán do Obchodního systému M s maximální cenou pro nákup 100 EUR a dodatečnou minimální limitní cenou pro nákup 95 EUR.

³⁸ Toto musí být prázdné podle oddílu 6.5.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Strike Match	Podle vlastní specifikace systémů.
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	100	
25	Další limitní cena	95	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	ACTI	Pokyn je aktivní pro závěrečnou aukci, ale bude proveden pouze v případě, že nezkřížená cena bude mezi 95–100 EUR.

6.13.3 Klasifikace limitního pokynu iceberg

Příklad 132

Dne 7. března 2018 v 10:10:32.652758(UTC) zadal Investiční podnik X limitní pokyn k nákupu typu „iceberg“ k provedení v Obchodním systému M. Pokyn slouží k nákupu celkem 150 akcií za 100,00 EUR. Pokyn iceberg je nastaven tak, aby se v knize pokynů zobrazovalo množství 50 akcií, zatímco 100 akcií zůstává účastníkům trhu skrytých (Událost 1).

Čtrnáct sekund po zadání do knihy pokynů Obchodního systému M je pokyn iceberg proveden pro celé zobrazené množství (50 akcií) (Událost 2).

Po částečném provedení pokynu iceberg je zobrazené množství okamžitě doplněno. V tomto případě jsou pro Obchodní systém M přidány 3 mikrosekundy, aby odrážely malé zpoždění v systémech obchodního systému (Událost 3).

Událost 1: pokyn vstupuje do knihy pokynů

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			

21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	2	Podle vlastní klasifikace Obchodního systému M
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	100,00	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	150	
37	Zbývající a skryté množství	150	
38	Zobrazované množství	50	

Událost 2: pokyn iceberg je proveden pro celé zobrazené množství

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:46.652785Z	K obchodu dojde 14 sekund po zadání do knihy pokynů
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:32.652785Z	<i>Žádná změna.</i>
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	PARF	Pokyn je částečně proveden
Oddíl I – Ceny			
28	Cena obchodu	100,00	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	150	<i>Žádná změna</i>
37	Zbývající a skryté množství	100	
38	Zobrazované množství	0	Doplnění zobrazeného množství se odrazí v další události

39	Obchodované množství	50	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	ABC123456	

Událost 3: zobrazené množství pokynu iceberg je doplněno

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:46.652788Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:46.652788Z	Po doplnění dostává pokyn iceberg nové časové razítko priority (tj. datum a čas události doplnění).
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	REMA	Nahrazen tržními operacemi (automaticky).
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	150	Žádná změna
37	Zbývající a skryté množství	100	Žádná změna
38	Zobrazované množství	50	

6.13.4 Pokyny peg (vázané)³⁹

Příklad 133

Dne 7. března 2018 v 10:10:32.652785(UTC) zadává investiční podnik pokyn peg k nákupu k provedení v Obchodním systému M. Při zadávání pokynu obchodník uvádí, že:

- Množství se rovná 150 bez skrytého množství;
- Pokyn se naváže na nejlepší nabídku obchodního systému;

³⁹ Pro účely tohoto příkladu je vázaný (pegged) pokyn limitní pokyn k nákupu nebo prodeji uvedeného množství cenných papírů za zobrazenou cenu nastavenou tak, aby sledovala cenový bod v knize pokynů obchodního systému.

- Pokyn je nastavený tak, aby se navazoval na nabídkovou cenu až do výše 100,10 EUR (tj. pokud bude nabídková cena vyšší než 100,10 EUR, zůstane pokyn peg na limitu 100,10 EUR).

Obchodní systém M zpracuje pokyn peg následujícím způsobem:

Pokyn se zařadí s nejnižší prioritou;

Pokyn se naváže na nejlepší nabídkovou cenu se zpožděním 50 ms⁴⁰.

Stav knihy pokynů předtím,⁴¹ než je pokyn zadán do Obchodního systému M

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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

Událost 1: pokyn vstupuje do knihy pokynů Obchodního systému M

Stav knihy pokynů Obchodního systému M při zadání pokynu

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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

S ohledem na knihu pokynů Obchodního systému M se zadaný pokyn peg automaticky připojí k ostatním pokynům za nejlepší nabídkovou cenu (počáteční limitní cena 99,99 EUR).

⁴⁰ Toto zpoždění je technickou nutností specifickou pro každý obchodní systém, který nabízí typ vázaného pokynu (tyto informace nejsou obvykle zveřejňovány).

⁴¹ V každé tabulce zobrazené níže ukazují dva sloupce nalevo („BID“) pokyny k nákupu akcií, které již existují v knihách pokynů, zatímco dva sloupce napravo („ASK“) ukazují pokyny k prodeji akcií, které již existují v knihách pokynů.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:32.652785Z	Pokyn peg je zařazen s nejnižší prioritou. Časová razítka priority se však vyplní, aby se určila priorita mezi různými pokyny peg.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	P	Podle vlastní klasifikace Obchodního systému M
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Pokyn peg je limitní pokyn s limitní cenou, která se automaticky mění
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	99,99	
27	Vázaná limitní cena (Pegged limit price)	100,10	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	150	
37	Zbývající a skryté množství	150	
38	Zobrazované množství	150	Žádné skryté množství

Událost 2: limitní cena pokynu peg se mění po zadání nového pokynu do knihy pokynů

V 10:10:45.685975(UTC) vstupuje do knihy pokynů pokyn good-for-day k nákupu 200 akcií za 100,00 EUR. Tento pokyn neobchoduje a zůstává viditelný v knize pokynů. Proto se o 50 milisekund později limitní cena pokynu peg sladí s limitní cenou naposledy zadaného pokynu k nákupu.

Stav knihy pokynů v Obchodním systému M

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství

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		

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:45.735975 Z	Pokyn se sladí s nově zadaným pokynem po prodlevě 50 milisekund
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:32.735975Z	Nezměněno.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	REMA	Nahrazen tržními operacemi. Limitní cena pokynu peg je automaticky změněna systémem obchodního systému
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	100,00	Limitní cena se sladí s novou nejlepší nabídkou
27	Vázaná limitní cena (Pegged limit price)	100,10	Nezměněno

Událost 3: do knihy pokynů vstupuje nový limitní pokyn k nákupu, obchoduje se až do 100,15 EUR a není zcela proveden

V 10:10:59.256789(UTC) je zadán limitní pokyn good-for-day k nákupu 600 akcií za 100,15 EUR. Tento pokyn obchoduje 100 akcií za 100,03 EUR, 100,05 EUR, 100,08 EUR, 100,10 EUR a 100,15 EUR. Zbývající objem (100) zůstává v knize pokynů. 50 milisekund po posledním obchodu je limitní cena pokynu peg změněna tržními operacemi ze 100,00 EUR na 100,10 EUR: limitní cena pokynu peg nemůže být nastavena výš, protože jeho limitní cena byla obchodníkem omezena na 100,10 EUR.

Stav knihy pokynů v Obchodním systému M

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	100,15	100,20	100
150	100,10		
200	100,00		

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:10:59.306789Z	50 ms po posledním obchodu
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:10:32.652785Z	<i>Nezměněno</i>
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	REMA	Nahrazen tržními operacemi. Limitní cena pokynu peg je automaticky změněna systémem Obchodního systému M.
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	100,10	Limitní cena je omezena na 100,10 (jak je uvedeno v poli 27)
27	Vázaná limitní cena (Pegged limit price)	100,10	<i>Nezměněno</i>

6.13.5 Klasifikace pokynu Stop

Příklad 134

Dne 7. března 2018 v 10:05:32.652785(UTC) zadal investiční podnik pokyn stop buy na 150 akcií pro finanční nástroj v Obchodním systému M. Pokyn je nastaven tak, aby se spustil, až se akcie bude obchodovat za cenu 100,02 EUR nebo vyšší. Při spuštění se pokyn změní na:

- podle varianty A: tržní pokyn (bez limitní ceny) a;
- podle varianty B: limitní pokyn (s limitní cenou 101,00 EUR).

Doba platnosti pokynu je Good-Till-Cancelled, to znamená, že pokyn zůstane v knize pokynů, dokud nebude buď spuštěn, nebo zrušen.

Událost 1: pokyn vstupuje do knihy pokynů Obchodního systému M

Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost			
Č.	Pole		Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:05:32.652785Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:05:32.652785Z	Protože pokyn právě vstoupil do knihy pokynů, jeho časové razítko priority se rovná datu a času zadání. Časové razítko priority u pokynu STOP se posoudí podle ostatních pokynů STOP
Oddíl F – Identifikace kódu pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	4 podle <u>varianty A</u> a S podle <u>varianty B</u>	Podle vlastní klasifikace obchodního systému
23	Klasifikace typu pokynu	STOP	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	[Prázdná] podle <u>varianty A</u> a 101,00 podle <u>varianty B</u>	
26	Stop cena (Stop price)	100,02	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	INAC	
36	Původní množství	150	

Událost 2: účastník trhu kupuje 20 akcií za 100,02 EUR v Obchodním systému M, a proto se spouští pokyn Stop

Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost			
Č.	Pole		Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			

9	Datum a čas	2018-03-07T10:05:55.652785Z	K události spuštění dochází 23 sekund po přijetí pokynu stop obchodním systémem.
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů			
10	Doba platnosti	IOCV	„Immediate-Or-Cancel“
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	TRIG	Spuštěno
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	4 podle varianty A S podle varianty B	Po aktivaci zůstává typ pokynu stejný; mění se však jeho klasifikace (pole 23)
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Po aktivaci se pokyn stop klasifikuje jako limitní pokyn.
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	[Prázdná] podle <u>varianty A</u> a 101,00 podle <u>varianty B</u>	
26	Stop cena (Stop price)	100,02	Stop cena zůstává vyplněná, i když se nebere v úvahu, jakmile se stav v poli 33 změní na „ACTI“
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ACTI	Po spuštění pokynu stop se jeho stav změní na „aktivní“.

6.13.6 Směřované pokyny

Příklad 135

Dne 7. března 2018 v 10:05:32(UTC) zadává Investiční podnik X limitní pokyn k nákupu k provedení v Obchodním systému M. Pokyn slouží k nákupu 150 akcií za 100,02 EUR. Při zadávání pokynu do Obchodního systému M obchodník specifikuje, že pokyn se směřuje do jiného obchodního systému (Obchodního systému N), pokud nemůže být proveden v Obchodním systému M, ať už zcela (varianta A), nebo částečně (varianta B). V rámci každé varianty se neobchodovaný objem (v rámci varianty A) nebo zbývající objem (v rámci varianty B) pokynu směřuje do Obchodního systému N.

Směřovaný pokyn je částečně proveden v Obchodním systému N. Tento obchod v obchodním systému N se zaznamená v systémech Obchodního systému M.

V rámci obou variant obchodník rovněž specifikuje, že v případě, že pokyn nemůže být zcela proveden v Obchodním systému N, vrátí se do Obchodního systému M. Proto je po částečném provedení v Obchodním systému N pokyn reaktivován v knize pokynů Obchodního systému M.

Pro účely směrování pokynu z Obchodního systému M do Obchodního systému N poskytuje Investiční podnik Z jednající jako člen Obchodního systému N službu přímého elektronického přístupu.

Stav knih pokynů⁴² před zadáním pokynu do Obchodního systému M

Stav knihy pokynů v Obchodním systému M, do kterého je pokyn původně zadán

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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

Stav knihy pokynů v Obchodním systému N, do kterého bude pokyn přesměrován

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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

Událost 1: pokyn vstupuje do knihy pokynů Obchodního systému M

Stav knihy pokynů Obchodního systému M při zadání pokynu

BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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		

S ohledem na knihu pokynů Obchodního systému M nemůže být zadán limitní pokyn proveden (vůbec neodpovídá protější straně).

Pokyn se odrazí v záznamu Obchodního systému M jako nový pokyn (viz oddíl 6.13.1) Dále se vyplní Strategie směrování (pole 47) jako alfanumerický text (maximálně 50 znaků) na základě specifikace Obchodního systému M.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
----	------	---	--------------------------

⁴² V každé tabulce zobrazené níže ukazují dva sloupce nalevo („BID“) pokyny k nákupu akcií, které již existují v knihách pokynů, zatímco dva sloupce napravo („ASK“) ukazují pokyny k prodeji akcií, které již existují v knihách pokynů. Pro účely tohoto obecného pokynu odráží každý limitní pokyn pouze jeden pokyn.

Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
47	Strategie směřování	ROUTING_TO_TV_N_ONLY	Alfanumerický text (maximálně 50 znaků) podle specifikace Obchodního systému M

Událost 2: pokyn je směřován do Obchodního systému N

Podle varianty A

Protože pokyn nemůže být proveden za 100,02 EUR v Obchodním systému M při zadání do knihy pokynů, je směřován do Obchodního systému N na základě instrukce specifikované obchodníkem. V důsledku toho se pokyn odstraní z knihy pokynů Obchodního systému M. Pokud však není pokyn zcela proveden v Obchodním systému N, neobchodované množství se vrací do knihy pokynů Obchodního systému M podle původních instrukcí obchodníka.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:05:32.652788Z	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	CHMO	„Změna stavu v důsledku tržních operací“
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ROUT	Pokyn je směřován do Obchodního systému N.
36	Původní množství	150	<i>Žádná změna</i>
37	Zbývající a skryté množství	150	Toto pole rovněž odpovídá množství, které je směřováno do druhého obchodního systému
38	Zobrazované množství	0	Zatímco je směřován do jiného obchodního systému, nezobrazuje se u pokynu v Obchodním systému M žádné množství.

Podle varianty B

Pokyn byl částečně proveden v Obchodním systému M (nákup 25 akcií), než byl směřován do Obchodního systému N se zbývajícím množstvím (125 akcií). Toto směřování pokynu po částečné události se odráží v záznamech Obchodního systému M v následujících polích.

Č.	Pole	Normy a formáty	Popis (je-li relevantní)
----	------	-----------------	--------------------------

údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost			
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ROUT	Pokyn je SMĚROVÁN do Obchodního systému N.
36	Původní množství	150	Žádná změna
37	Zbývajících a skrytých množství	125	Zde se odráží množství, které stále zůstává k obchodování po nákupu 25 akcií v Obchodním systému M
38	Zobrazované množství	0	Zatímco je směrován do jiného obchodního systému, nezobrazuje se u pokynu v Obchodním systému M žádné množství
39	Obchodované množství		Nákup 25 akcií byl zaznamenán v předchozí události

Následující tabulka ukazuje, jak se příchozí pokyn směrovaný z Obchodního systému M odráží v záznamu Obchodního systému N.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	LEI Investičního podniku Z, který je členem Obchodního systému N a předává pokyn na účet Obchodního systému M	
2	Přímý elektronický přístup (DEA)	ano	
3	Identifikační kód zákazníka	LEI Obchodního systému M	V tomto případě je Obchodní systém M zákazníkem člena Obchodního systému N (Investičního podniku Z). Pokud by mezi nimi existoval ještě další zprostředkovatel, nevyplní se v tomto poli LEI Obchodního systému M.
Oddíl B – Postavení a poskytování likvidity			
7	Postavení	AOTC	Investiční podnik Z jedná na účet Obchodního systému M.
Oddíl F – Identifikace kódu pokynu			
16	Kód MIC segmentu	Kód segmentu MIC Obchodního systému N	

Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	IOC_ORDER	Podle vlastní klasifikace Obchodního systému N
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	150 podle varianty A a 125 podle varianty B	
37	Zbývajících a skrytých množství	150 podle varianty A a 125 podle varianty B	

Událost 3: při zadání do knihy pokynů Obchodního systému N je pokyn částečně proveden

Pokyn se odrazí v záznamu Obchodního systému N jako částečně provedený pokyn (viz oddíl 6.13.1.4). Dále se vyplní pole 48 takto:

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	DEF54321	

Podle varianty A

Při zadání pokynu do knihy pokynů Obchodního systému N je v obchodním systému zakoupeno 100 akcií. Tento nákup v Obchodním systému N se musí odrazit v záznamech Obchodního systému M ve vztahu k původnímu pokynu.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:05:32.662788Z	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí,	PARF	Pokyn je částečně proveden

	částečné a úplné provedení		
Oddíl I – Ceny			
28	Cena obchodu	100,01	Pokyn byl částečně proveden v Obchodním systému N za 100,01
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ROUT	Žádná změna
36	Původní množství	150	Žádná změna
37	Zbývajících a skrytých množství	50	
38	Zobrazované množství	0	Protože pokyn je stále ve stavu „směřován“.
39	Obchodované množství	100	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému		Toto pole je prázdné, protože tento obchod nebyl proveden v Obchodním systému M

Podle varianty B

Před přesměrováním do Obchodního systému N je pokyn částečně proveden v Obchodním systému M (nákup 25 akcií). V důsledku toho se pokyn směřovaný do Obchodního systému N týká pouze 125 akcií. Při vstupu do knihy pokynů Obchodního systému N je pokyn částečně proveden (nákup 100 akcií).

Obchod v Obchodním systému N se odrazí v záznamech Obchodního systému M, jak bylo ukázáno v předchozí tabulce, s výjimkou následujících polí.

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	PARF	Pokyn je částečně proveden
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ROUT	
36	Původní množství	150	Původní množství je podle varianty B nezměněno
37	Zbývajících a skrytých množství	25	25 akcií bylo již koupeno v Obchodním systému M, než byl pokyn směřován.
38	Zobrazované množství	0	
39	Obchodované množství	100	

48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému		Toto pole je prázdné, protože tento obchod nebyl proveden v Obchodním systému M
----	---	--	---

Událost 4: směrovaný pokyn je reaktivován v knize pokynů Obchodního systému M

Č.	Pole	Normy a formáty údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:05:32.662791Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:05:32.662791Z	Pokyn ztratil svoje časové razítko priority, když byl směrován do Obchodního systému N. Časové razítko priority se rovná času, kdy vstoupil zpět do knihy pokynů Obchodního systému M.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	CHMO	„Změna stavu v důsledku tržních operací“
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	100,02	Žádná změna
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
33	Stav pokynu	ACTI	Podle této události se pokyn aktivuje v knize pokynů Obchodního systému M.
36	Původní množství	150	Žádná změna
37	Zbývajících a skrytých množství	50 podle varianty A a 25 podle varianty B	
38	Zobrazované množství	50 podle varianty A a 25 podle varianty B	

6.13.7 Klasifikace strategických pokynů (pole 46)

6.13.7.1 Funkce implied in

Příklad 136

Pokyn Investičního podniku X

Investiční podnik X chce zadat pokyn do červencové opce (realizační cena 225) do Obchodního systému M. Dne 10. března 2018 v 10:07:16.523871(UTC) zadá Investiční podnik X přímý pokyn s koncem platnosti v červenci k nákupu 200 kupních opcí s realizační cenou 225 a cenou 13 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro červencové kupní opce je 256718 a ISIN je XX1234567890.

Pokyn Investičního podniku Y

Jiný investiční podnik (Podnik Y) chce zadat pokyn do srpnové opce (realizační cena 225) do Obchodního systému M. Dne 7. března 2018 v 10:09:38.981242(UTC) zadá Investiční podnik Y přímý pokyn s koncem platnosti v srpnu k prodeji 100 kupních opcí s realizační cenou 225 a cenou 15,5 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro srpnové kupní opce je 256735.

Pokyn implied in – Opční kalendářní spread

Funkce implikovaného pokynu Obchodního systému M znamená, že dva přímé pokyny vytvoří pokyn implied in ve strategii opčního kalendářního spreadu. Tento implikovaný pokyn je prodat 100 červenec–srpen FCAL za cenu 2,5 EUR. Ten je šířen na trh prostřednictvím datového kanálu. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro FCAL červenec–srpen 225 je 256786.

Pokyn Investičního podniku Z

Investiční podnik Z s LEI KLMNOPQRST1234567890 chce zadat pokyn do stejného opčního kalendářního spreadu. Dne 7. března 2018 v 10:09:56.684251(UTC) Investiční podnik Z zadá pokyn do kalendářního spreadu k nákupu 100 červenec–srpen FCAL 225 za cenu 2,5 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro FCAL červenec–srpen 225 je 256786 a ISIN je XXQRSTUVWXYZ. Ten je okamžitě proveden proti pokynu implied in uvedenému výše.

Událost 1: Pokyn Investičního podniku X vstupuje do knihy pokynů

Stav knihy pokynů⁴³ při zadání pokynu (nový pokyn zvýrazněný červeně)

Červencový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Srpnový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

⁴³ V každé tabulce zobrazené níže ukazují dva sloupce nalevo („BID“) pokyny k nákupu, které již existují v knihách pokynů, zatímco dva sloupce napravo („ASK“) ukazují pokyny k prodeji, které již existují v knihách pokynů. Pro účely těchto obecných pokynů existuje pouze jeden pokyn na každé cenové úrovni.

FCAL červenec–srpen 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	2,00	5,25	100

Pro červencový nákup 225: Přímý pokyn z Investičního podniku X je koupit 200 kupních opcí za červenec s realizační cenou 225 za cenu 13 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro červencové kupní opce 225 je 256718. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	12345678901234567890	
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:07:16.523871Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Protože pokyn právě vstoupil do knihy pokynů, jeho časové razítko priority se rovná datu a času zadání
15	Pořadové číslo	3758945	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256718	
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890	
20	Identifikační kód pokynu	Xj26F458s	Jedinečný kód pokynu v obchodním systému.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	I když je pokyn proveden při zadání do knihy pokynů, první událostí, která se hlásí, je „Nový pokyn“
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Podle vlastní klasifikace obchodního systému.
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	13	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	ACTI	

36	Původní množství	200	
37	Zbývající a skryté množství	200	
38	Zobrazované množství	200	
46	Identifikační kód podle strategie		Prázdné, protože ještě není proveden.

Událost 2: Pokyn Investičního podniku Y vstupuje do knihy pokynů

Stav knihy pokynů⁴⁴ při zadání pokynu (nový pokyn zvýrazněn červeně)

Červencový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Srpnový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

FCAL červenec–srpen 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	2,00	5,25	100

⁴⁴ V každé tabulce zobrazené níže ukazují dva sloupce nalevo („BID“) pokyny k nákupu, které již existují v knihách pokynů, zatímco dva sloupce napravo („ASK“) ukazují pokyny k prodeji, které již existují v knihách pokynů. Pro účely těchto obecných pokynů existuje pouze jeden pokyn na každé cenové úrovni.

Pro srpnový nákup 225: Přímý pokyn z Investičního podniku Y je prodán 100 kupních opcí za srpen s realizační cenou 225 za cenu 15,5 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro srpnové kupní opce 225 je 256735. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	ABCDEFGHIJKLMNQRST	
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Protože pokyn právě vstoupil do knihy pokynů, jeho časové razítko priority se rovná datu a času zadání
15	Pořadové číslo	3758946	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256735	Kód knihy pokynů obchodního systému.
18	Identifikační kód finančního nástroje	XXABCDEFGHIJ	
20	Identifikační kód pokynu	Xj26F459n	Jedinečný kód pokynu v Obchodním systému M.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	I když je pokyn proveden při zadání do knihy pokynů, první událostí, která se hlásí, je „Nový pokyn“
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Podle vlastní klasifikace Obchodního systému M.
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	15,5	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	100	
38	Zobrazované množství	100	
46	Identifikační kód podle strategie		Prázdný, protože ještě není proveden.

Červencový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Srpnový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

Událost 3: Pokyn implied in vstupuje do knihy pokynů

Stav knihy pokynů⁴⁵ při zadání implikovaného pokynu (nový pokyn zvýrazněn červeně)

FCAL červenec–srpen 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	2,00	2,50	100
		5,25	100

Pro knihu pokynů FCAL červenec–srpen 225: Pokyn implied in je vytvořen Obchodním systémem M ze dvou přímých pokynů zadaných Investičními podniky X a Y ve vztahu k červencovým a srpnovým kupním opcím. Pokyn implied in je pokyn k prodeji 100 červenec–srpen FCAL za cenu 2,5 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro FCAL červenec–srpen 225 je 256786. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny. Pole 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 a 8 budou vždy prázdná, protože jde o implikovaný pokyn, který byl vytvořen obchodním systémem, nikoli členem/účastníkem.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Protože pokyn právě vstoupil do knihy pokynů, jeho časové razítko

⁴⁵ Pro účely těchto obecných pokynů existuje pouze jeden pokyn na každé cenové úrovni.

			priority se rovná datu a času zadání
15	Pořadové číslo	3758947	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256786	Kód knihy pokynů Obchodního systému M.
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Vzhledem k tomu, že strategie nejsou finanční instrumenty, nemají ISIN a uvádí se tedy ISIN kódy instrumentů, ze kterých se strategie skládá.
20	Identifikační kód pokynu	Xj26F460g	Jedinečný kód pokynu v Obchodním systému M.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	I když je pokyn proveden při zadání do knihy pokynů, první událostí, která se hlásí, je „Nový pokyn“
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Implied	Podle vlastní klasifikace obchodního systému.
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	2,5	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
33	Stav pokynu	IMPL	Uvádí, že jde o implikovaný pokyn z přímých pokynů.
36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	100	
38	Zobrazované množství	100	
46	Identifikační kód podle strategie		Prázdný, protože ještě není proveden.

Událost 4: Pokyn Investičního podniku Z vstupuje do knihy pokynů

Červencový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100

100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Stav knih pokynů (nový pokyn zvýrazněn červeně)

Srpnový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	

FCAL červenec–srpen 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Pro FCAL červenec–srpen 225: Pokyn do kalendářního spreadu od Investičního podniku Z je koupit 100 červenec–srpen FCAL za cenu 2,5 EUR. Kód knihy pokynů Obchodního systému M pro FCAL červenec–srpen 225 je 256786. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	KLMNOPQRST1234567890	
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Protože pokyn právě vstoupil do knihy pokynů, jeho časové razítko priority se rovná datu a času zadání
15	Pořadové číslo	3759523	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256786	Kód knihy pokynů Obchodního systému M.
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Vzhledem k tomu, že strategie nejsou finanční instrumenty, nemají ISIN a uvádí se tedy ISIN kódy instrumentů, ze kterých se strategie skládá.

20	Identifikační kód pokynu	Xj26H127c	Jedinečný kód pokynu v Obchodním systému M.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO	I když je pokyn proveden při zadání do knihy pokynů, první událostí, která se hlásí, je „Nový pokyn“
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Podle vlastní klasifikace obchodního systému
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	2,5	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
33	Stav pokynu	ACTI	
36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	100	
38	Zobrazované množství	100	
46	Identifikační kód podle strategie		Prázdný, protože ještě není proveden.

Událost 5: Provedení v knize pokynů kalendářního spreadu a změny pokynů v přímých smlouvách.

Stav knihy pokynů⁴⁶ v okamžiku provedení

⁴⁶ Pokyny zvýrazněné oranžově provádějí, a to vede k aktualizaci pokynu u pokynu zvýrazněného modře a úplnému provedení u pokynu zvýrazněného fialově

Červencový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	13,00	13,00	100
100	11,25	13,25	100
100	11,20	13,30	100
100	11,15	13,35	100

Srpnový nákup 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
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 červenec–srpen 225			
BID		ASK	
Množství	Limitní cena	Limitní cena	Množství
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Pokyn do kalendářního spreadu od Investičního podniku Z koupit 100 červenec–srpen FCAL za cenu 2,5 EUR je zcela proveden. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	KLMNOPQRST1234567890	Žádná změna
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Čas této události.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován, a není proto již aktivní.
15	Pořadové číslo	3759539	Pořadové číslo této zprávy.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256786	Žádná změna
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Žádná změna
20	Identifikační kód pokynu	Xj26H127c	Žádná změna
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	FILL	Pokyn byl zcela zobchodován.

Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Žádná změna
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Žádná změna
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	2,5	Žádná změna
28	Cena obchodu	2,5	Cena provedení.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	Žádná změna
33	Stav pokynu		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován.
36	Původní množství	100	Žádná změna
37	Zbývající a skryté množství	0	Zbývající množství je nyní 0.
38	Zobrazované množství	0	Zobrazené množství je 0, protože bylo zcela zobchodováno.
39	Obchodované množství	100	Odráží obchodované množství.
46	Identifikační kód podle strategie		Prázdné, protože tento pokyn byl zadán přímo do knihy pokynů kalendářního spreadu.
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	TEKXC456GH20	Vyplněno, aby byl uveden jedinečný ID obchodu pro provedený obchod.

U pokynu k prodeji v knize pokynů kalendářního spreadu: Pokyn implied in prodat 100 červenec–srpen FCAL za cenu 2,5 EUR je zcela proveden. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny. Pole 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 a 8 budou vždy prázdná, protože jde o implikovaný pokyn, který byl vytvořen obchodním systémem, nikoli členem/účastníkem.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Čas této události.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován, a není proto již aktivní.
15	Pořadové číslo	3759540	Pořadové číslo této zprávy.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256786	Žádná změna
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Žádná změna
20	Identifikační kód pokynu	Xj26F460g	Žádná změna
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			

21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	FILL	Pokyn byl zcela zobchodován.
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Implied	Žádná změna
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Žádná změna
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	2,5	Žádná změna
28	Cena obchodu	2,5	Cena provedení.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	Žádná změna
33	Stav pokynu		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován.
36	Původní množství	100	Žádná změna
37	Zbývající a skryté množství	0	Zbývající množství je nyní 0.
38	Zobrazované množství	0	Zobrazované množství je 0, protože bylo zcela zobchodováno.
39	Obchodované množství	100	Odráží obchodované množství.
46	Identifikační kód podle strategie	Xj26K983c	Vyplněno, aby se propojily relevantní přímé pokyny, které byly součástí provedení.
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	TEKXC456GH20	Vyplněno, aby byl uveden jedinečný ID obchodu pro provedený obchod.

Pro červencový nákup 225: Přímý pokyn z Investičního podniku X koupit 200 kupních opcí za červenec s realizační cenou 225 za cenu 13 EUR je částečně proveden u 100. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	12345678901234567890	Žádná změna
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Čas, kdy byl zadán přímý pokyn
15	Pořadové číslo	3759541	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256718	Žádná změna
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX1234567890	Žádná změna

20	Identifikační kód pokynu	Xj26F458s	Žádná změna
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	PARF	
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Žádná změna
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Žádná změna
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	13	Žádná změna
28	Cena obchodu	13	Cena provedení.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	Žádná změna
33	Stav pokynu	ACTI	Žádná změna
36	Původní množství	200	Žádná změna
37	Zbývající a skryté množství	100	.
38	Zobrazované množství	100	
39	Obchodované množství	100	Odráží obchodované množství u této události.
46	Identifikační kód podle strategie	Xj26K983c	Vyplněn, aby spojoval relevantní přímé pokyny s implikovaným pokynem, který byl součástí provedení.
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	TEKXC456GH18	Vyplněn, aby uváděl jedinečné ID obchodu pro provedený obchod. Jedná se o odlišné ID obchodu, než které je v knize pokynů kalendářního spreadu.

Pro srpnový nákup 225: Přímý pokyn z Investičního podniku X prodat 100 kupních opcí za srpen s realizační cenou 225 za cenu 15,5 EUR je zcela proveden. Následující tabulka zvýrazňuje hlavní pole, která se vyplní, ale ne všechny:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl A – Identifikace příslušných stran			
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	ABCDEFGHIJKLMNQRST	Žádná změna
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-03-07T10:09:56.684251Z	

Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován, a není proto již aktivní.
15	Pořadové číslo	3759542	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
17	Kód knihy pokynů	256735	Žádná změna
18	Identifikační kód finančního nástroje	XXABCDEFGHIJ	Žádná změna
20	Identifikační kód pokynu	Xj26F459n	Žádná změna
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	FILL	Pokyn byl zcela zobchodován.
Oddíl H – Typ pokynu			
22	Typ pokynu	Limit	Žádná změna
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO	Žádná změna
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	15,5	Žádná změna
28	Cena obchodu	15,5	Cena provedení.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	Žádná změna
33	Stav pokynu		Prázdné, protože pokyn byl zcela zobchodován.
36	Původní množství	100	Žádná změna
37	Zbývající a skryté množství	0	Zbývající množství je nyní 0.
38	Zobrazované množství	0	Zobrazené množství je 0, protože bylo zcela zobchodováno.
39	Obchodované množství	100	Odráží obchodované množství.
46	Identifikační kód podle strategie	Xj26K983c	Vyplněno, aby byly relevantní přímé pokyny propojeny s implikovaným pokynem, který byl součástí provedení.
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	TEKXC456GH19	Vyplněno, aby byl uveden jedinečný ID obchodu pro provedení obchodu. Jedná se o odlišné ID obchodu, než které je v knize pokynů kalendářního spreadu.

6.13.7.2 Funkce implied out

U pokynů implied out se musí použít stejná metodika.

6.13.8 Změna priority

Popsány jsou následující situace:

- Časová razítka priority pro obchodní systém s prioritou cena-viditelnost-čas;
- Časová razítka priority a objem prioritního pokynu u systému obchodování s prioritou objem-čas;
- Časová razítka priority a objem prioritního objemu u obchodního systému s párováním pro-rata.

6.13.8.1 Priorita cena-čas-viditelnost

Příklad 137

Investiční podnik X zadává nový pokyn k nákupu Good-Till-Cancelled na 50 akcií za cenový limit 10,000 EUR dne 30. června 2018 v 11:20:30.112121(UTC) (Událost 1). O okamžik později, v 11:20:31.354454(UTC), zadává Investiční podnik Y nový pokyn k nákupu, Good-For-Day, na 70 akcií na stejné úrovni cenového limitu 10,000 EUR (Událost 2).

Vzhledem k pravidlu priority cena čas bude pokyn na 70 akcií umístěn do knihy pokynů obchodního systému na stejnou cenovou úroveň, ale za pokyn na 50 akcií. Rozdílné priority budou určeny hodnotami v poli časového razítka priority.

Pokud dojde ke změně pokynu na 50 akcií zvýšením jeho množství na 55 akcií dne 27. června 2018 v 11:20:33.344541(UTC), ztratí svoji prioritu před pokynem na 70 akcií. Proto se přesný čas těchto změn pokynu zaznamená v poli Časové razítka priority (Událost 3).

V tomto obchodním systému jsou pokyny Good-Till-Cancelled platné 1 rok.

Událost 1: Zadání nového pokynu k nákupu Good-Till-Cancelled na 50 akcií

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-06-27T11:20:30.112121Z
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	GTCA
12	Datum a čas doby platnosti	2018-06-27T23:59:59.999999Z
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítka priority	2018-06-27T11:20:30.112121Z
Oddíl F – Identifikace pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit

23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	10,000
28	Cena obchodu	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
36	Původní množství	50

Událost 2: Zadání nového pokynu k nákupu Good-For-Day na 70 akcií

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-06-27T11:20:31.354454Z
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	DAVY
12	Datum a čas doby platnosti	2018-06-27T23:59:59.999999Z
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:31.354454Z
Oddíl F – Identifikace pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	45533344ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	NEWO
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	10,000
36	Původní množství	70

Událost 3: Pokyn na 50 akcií změněn

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-06-27T11:20:33.344541Z
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	GTCV
12	Datum a čas doby platnosti	2018-06-27T23:59:59.999999Z
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:33.344541Z

Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	REME
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	10,000
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
36	Původní množství	55

6.13.8.2 Priorita objem–čas

Příklad 138

Investiční podnik X zadává nový pokyn k nákupu 100 akcií na určité cenové úrovni dne 27. června 2018 v 11:20:30.112121(UTC) (Událost 1).

O okamžik později, v 11:20:31.354454(UTC), zadává Investiční podnik Y nový pokyn k nákupu na stejné cenové úrovni, ale s vyšším množstvím (325 akcií) (Událost 2). V tomto obchodním systému získají pokyny pro vyšší množství přednost před pokyny pro nižší množství.

Vzhledem k prioritě objem–čas bude pokyn na 325 akcií umístěn v knize před pokyn na 100 akcií. Příslušný orgán bude schopen provést rekonstrukci tím, že nejprve zohlední objemovou prioritu a poté časové znaménko priority u pokynů, které jsou – u každého pokynu samostatně – zaregistrovány obchodním systémem v poli Časové razítko priority a Objemová priorita. Pokud dojde ke změně pokynu na 325 akcií snížením jeho množství na 90 akcií dne 27. června 2018 v 11:20:35.325891(UTC), ztratí svoji prioritu před pokynem na 100 akcií. Tato změna pokynu musí být zaznamenána v poli Časové razítko priority a Objemová priorita (Událost 3).

U případů popsaných výše se vyplní pole Časové razítko priority a Objemová priorita – samostatně u každého pokynu a změny pokynu – takto. Z praktických důvodů jsou zobrazeny pouze pole 13 a 14, protože to jsou nejrelevantnější pole pro tento příklad.

Událost 1: zadání pokynu na 100 akcií

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Objemová priorita	100

Událost 2: zadání pokynu na 325 akcií:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:31.354454Z
14	Objemová priorita	325

Událost 3: změna pokynu z 325 akcií na množství 90 akcií

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:35.325891Z
14	Objemová priorita	90

6.13.8.3 Systém obchodování párováním pro-rata

Příklad 139

Investiční podnik X zadává nový pokyn k nákupu 200 akcií s cenovým limitem 10,000 EUR dne 27. června 2018 v 11:20:30.112121(UTC) v knize pokynů používající algoritmus párování pro-rata, kdy množství u přichoziho pokynu je rozloženo rovnoměrně u všech spících pokynů úměrně k jejich zbytkovému množství.

Obchodní systémy, které používají párovací algoritmy pro-rata, budou schopny vyplnit v poli 14 Objemová priorita hodnotu „0“ (nula), pokud zveřejňují údaje o algoritmu, které umožní příslušným orgánům rekonstruovat mechanismus provedení pokynu. V souladu s tím se pole 13 a 14 vyplní následujícím způsobem:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo		
13	Časové razítko priority	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Objemová priorita	0

6.13.9 Fáze obchodování

Příklad 140

Obchodní systém M má úvodní aukci s finančním nástrojem, která začíná v 07:50:00.425381(UTC+1) dne 27. června 2018. Před ní nejsou v knize pokynů žádné pokyny. Orientační aukční cena není ještě stanovena, protože žádné pokyny neexistují, a orientační objem aukce je 0 akcií (Událost 1).

V 07:55:21.528754(UTC+1) zadává Investiční podnik X pokyn k nákupu 100 akcií za 1 EUR (Událost 2).

V 07:57:46.255897(UTC+1) zadává Investiční podnik Y pokyn k prodeji 50 akcií na trhu. Tím se vytvoří křížová kniha pokynů, a tudíž orientační cena 1 EUR a orientační objem 50 akcií (Událost 3). V 07:59:52.264547(UTC+1) zadá podnik nabídku na 25 akcií na trhu. Ta nemá žádný vliv na orientační cenu, ale orientační objem se zvýší na 75 akcií (Událost 4). V 08:00:25.149531(UTC+1) se na konci aukce pokyny spárují, kdy dva pokyny k prodeji zadané jako Události 3 a 4 jsou obchodovány s pokynem k nákupu zadaným v Události 2, a cenný papír poté vstoupí do kontinuálního obchodování (Událost 5). Fáze obchodování jsou zobrazeny v samostatném řádku. Řádek s fází obchodování se změní pokaždé, když dojde k její změně. Orientační aukční cena a orientační objem aukce se zobrazují společně na svém vlastním řádku a při každé změně hodnot.

Událost 1: Úvodní aukce

Řádek 1 bude obsahovat následující informace, přičemž všechna ostatní pole budou prázdná (včetně pole 50 (Orientační aukční cena) a 51 (Orientační objem aukce), protože tato pole nejsou vyžadována při zobrazení změny fáze obchodování). Jediná pole, která se vyplní, jsou:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
15	Pořadové číslo	20056	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
16	Kód MIC segmentu	XMIC	
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876	
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000	
20	Identifikační kód pokynu		Prázdné, protože změna fáze obchodování.
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu		
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování	Otevřená aukce	

Protože začala úvodní aukce, pole Orientační aukční cena bude prázdné, čímž ukazuje, že orientační aukční cena nebyla stanovena, a orientační objem aukce 0 akcií musí být udržován. Proto ukazuje řádek 2 tyto informace, přičemž všechna ostatní pole jsou prázdná. Jediná pole, která se vyplní, jsou:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
15	Pořadové číslo	20068	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
16	Kód MIC segmentu	XMIC	
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876	
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000	
20	Identifikační kód pokynu		Prázdné, protože změna orientační ceny a objemu.
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože nebyla stanovena žádná cena.
51	Orientační objem aukce	0	Neexistuje žádný objem aukce.

Událost 2: Zadání pokynu na 100 akcií

Řádek 3 údajů bude obsahovat nové zadání pokynu takto (nebyla zahrnuta všechna pole zadání pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:55:21.528754Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-06-27T06:55:21.528754Z	
15	Pořadové číslo	20075	
Oddíl F – Identifikace kódu pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	NEWO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	1	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	

36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	100	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Událost 3: Zadání nového pokynu na 50 akcií

Řádek 4 údajů bude obsahovat nové zadání pokynu takto (nebyla zahrnuta všechna pole zadání pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
15	Pořadové číslo	20089	
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	987654321DEF	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	NEWO	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena		Prázdné, protože jde o tržní pokyn bez uvedení ceny.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
36	Původní množství	50	
37	Zbývající a skryté množství	50	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Řádek 5 údajů bude ukazovat vliv výše uvedeného zadání pokynu na orientační aukční cenu a orientační objem aukce se všemi ostatními poli prázdnými. Jediná pole, která se vyplní, jsou:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:57:46.255897Z	Žádná změna.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
15	Pořadové číslo	20095	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
16	Kód MIC segmentu	XMIC	
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876	
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000	
20	Identifikační kód pokynu		Prázdné, protože došlo ke změně orientační ceny a objemu.
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
50	Orientační aukční cena	1	
51	Orientační objem aukce	50	

Událost 4: Zadání nového pokynu na 25 akcií

Řádek 6 údajů bude obsahovat nové zadání pokynu takto (nebyla zahrnuta všechna pole zadání pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Čas, kdy byl pokyn zadán.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Stejný jako čas zadání.
15	Pořadové číslo	20156	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	543216789GHI	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	NEWO	

Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena		Prázdné, protože jde o tržní pokyn bez uvedení ceny.
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
36	Původní množství	25	
37	Zbývající a skryté množství	25	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Řádek 7 údajů bude ukazovat vliv na orientační aukční cenu a orientační objem aukce se všemi ostatními poli prázdnými. Jediná pole, která se vyplní, jsou:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Žádná změna.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
15	Pořadové číslo	20157	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
16	Kód MIC segmentu	XMIC	
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876	
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000	
20	Identifikační kód pokynu		Prázdné, protože došlo ke změně orientační ceny a objemu.
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
50	Orientační aukční cena	1	Žádná změna aukční ceny 1 £.
51	Orientační objem aukce	75	Objem je 75 akcií.

Událost 5: Spárování aukce a zahájení kontinuálního obchodování

Řádek 8 údajů bude ukazovat částečné provedení 50 akcií u pokynu k nákupu na 100 akcií (nebyla zařazena všechna pole pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Čas částečného provedení.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Stejný jako čas zadání, protože pokyn je stále aktivní.
15	Pořadové číslo	20189	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	PARF	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	1	
28	Cena obchodu	1	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	50	
39	Obchodované množství	50	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	ABC123456	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Řádek 9 údajů bude ukazovat provedení 50 akcií u pokynu k prodeji na 50 akcií (nebyla zařazena všechna pole pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Čas provedení.

Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority		Prázdné, protože pokyn již není aktivní.
15	Pořadové číslo	20190	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	987654321DEF	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	FILL	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena		Prázdné, protože jde o tržní pokyn bez uvedení ceny.
28	Cena obchodu	1	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
36	Původní množství	50	
37	Zbývající a skryté množství	0	
39	Obchodované množství	50	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	ABC123456	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Řádek 10 údajů bude ukazovat částečné provedení 25 akcií u pokynu k nákupu na 50 akcií (nebyla zařazena všechna pole pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Čas částečného provedení.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Stejný jako čas zadání.
15	Pořadové číslo	20256	Pořadové číslo této události je odlišné.

Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC	
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	PARF	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena	1	
28	Cena obchodu	1	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI	
36	Původní množství	100	
37	Zbývající a skryté množství	25	
39	Obchodované množství	25	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	DEF9876	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není pro danou událost vyžadováno.

Řádek 11 údajů bude ukazovat provedení 25 akcií u pokynu k prodeji na 25 akcií (nebyla zařazena všechna pole pokynu):

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Čas provedení.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
13	Časové razítko priority		Prázdné, protože pokyn byl proveden.
15	Pořadové číslo	20257	Pořadové číslo této události je odlišné.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
20	Identifikační kód pokynu	543216789GHI	

Oddíl G – Události mající vliv na pokyn			
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	FILL	
Oddíl I – Ceny			
24	Limitní cena		Prázdné, protože jde o tržní pokyn bez uvedení ceny.
28	Cena obchodu	1	
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů			
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL	
36	Původní množství	25	
37	Zbývající a skryté množství	0	
39	Obchodované množství	25	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	DEF9876	
Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem			
49	Fáze obchodování		Prázdné, protože není prodanou událost vyžadováno.
50	Orientační aukční cena		Prázdné, protože není prodanou událost vyžadováno.
51	Orientační objem aukce		Prázdné, protože není prodanou událost vyžadováno.

Změna fáze obchodování musí být znázorněna vlastním řádkem v rámci vedených údajů. Proto bude řádek 12 obsahovat následující informace, přičemž všechna ostatní pole jsou prázdná. Jediná pole, která se vyplní, jsou:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost	Popis (je-li relevantní)
Oddíl C – Datum a čas			
9	Datum a čas	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Časové razítko s podrobností na úrovni 1 mikrosekundy.
Oddíl E – Priorita a pořadové číslo			
15	Pořadové číslo	20258	Pořadové číslo této události v obchodním systému.
Oddíl F – Identifikace pokynu			
16	Kód MIC segmentu	XMIC	Žádná změna.
17	Kód knihy pokynů	XYZ9876	Žádná změna.
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000	Žádná změna.
20	Identifikační kód pokynu		Prázdný, protože došlo ke změně fáze obchodování.

Oddíl K – Fáze obchodování a orientační aukční cena a objem

49	Fáze obchodování	Kontinuální obchodování	Začalo obchodování.	kontinuální
----	------------------	-------------------------	---------------------	-------------

6.14 Systémy žádostí o kotace

V systému žádostí o kotace jsou kotace poskytovány v reakci na žádost o kotaci předloženou jedním nebo několika členy či účastníky. Kotace je vykonatelná výhradně žádajícím členem či účastníkem. Požadující člen nebo účastník může přijmout kotaci nebo kotace, které mu jsou poskytnuty. K tomuto přijetí kotace může dojít automaticky mezi některými protistranami.

Systém žádostí o kotace má specifické vlastnosti. Při vedení příslušných údajů týkajících se těchto specifických vlastností se musí pole tabulky vyplňovat stanoveným způsobem. Proto jsou uvedeny příklady pro následující specifické vlastnosti žádosti o kotaci:

Příklad 141: Jak zaznamenat žádost o kotaci, která je poslána konkrétním protistranám?

Příklad 142: Jak zaznamenat reakci na kotaci s omezenou dobou platnosti („on the wire time“), která je vykonatelná pouze pro specifického žadatele o kotaci?

Příklad 143: Jak zaznamenat reakci na kotaci s odlišným množstvím, než bylo požadováno?

Příklad 144: Jak zaznamenat provedení v systému žádostí o kotace?

6.14.1 Jak zaznamenat žádost o kotaci, která je poslána konkrétním protistranám

Žádost o kotaci se zaznamená jako nový pokyn s identifikačním kódem pokynu a do události pokynu (pole 21) se vyplní „RFQS“. Tím bude rozpoznatelná jako zadaná žádost o kotaci.

Dále se žádost o kotaci zaznamená jako zasláná trhu jako celku nebo konkrétním protistranám. K tomuto účelu se použije Strategie směřování (pole 47). Prázdné pole Strategie směřování se použije k vyznačení toho, že žádost o kotaci byla zaslána všem členům nebo účastníkům obchodního systému. Na druhou stranu LEI vyplněný v poli Strategie směřování udává, že žádost o kotaci byla zaslána příslušnému podniku. Pokud byla žádost o kotaci zaslána více než jednomu podniku, zaznamená se pro každý podnik nový případ tabulky polí (s následným LEI v poli Strategie směřování), ale u každého případu pod stejným identifikačním kódem pokynu.

Příklad 141

V obchodním systému žádosti o kotace dne 27. června 2018 ve 13:05:10(UTC) vyjádří Investiční podnik X zájem o prodej konkrétního nástroje ISIN XX0000000000 tím, že si vyžádá jednostrannou kotaci včetně objemu (1000) pro prodej tohoto nástroje členům, kteří zareagují na danou žádost o kotaci. Žádost o kotaci je zaslána pouze dvěma konkrétním členům: Investičnímu podniku Y (LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) a Investičnímu podniku Z (LEI KLMNOPQRST1234567890). Jak se to odrazí v tabulce polí žádosti o kotace obchodního systému?

Žádost o kotaci od Investičního podniku X Investičnímu podniku Y:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl A – Identifikace příslušných stran		

1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	12345678901234567890
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-06-27T13:05:10Z
Oddíl F – Identifikace pokynu		
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení pokynu	RFQS ⁴⁷
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL
36	Původní množství	1000
47	Strategie směřování	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

b) Žádost o kotaci Investičnímu podniku Z (která bude mít tabulku polí vyplněnou stejně jako žádost uvedená výše (včetně stejného identifikačního kódu pokynu), jediný rozdíl je v tom, že v poli Strategie směřování je vyplněn LEI Investičního podniku Z)

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl F – Identifikace pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
47	Strategie směřování	KLMNOPQRST1234567890

Pro příklady k aktualizaci kotací doporučujeme čtenáři, aby si přečetl oddíl 6.13.1.2.

6.14.2 Jak zaznamenat reakci na kotaci s omezenou dobou platnosti („on the wire time“), která je proveditelná pouze pro konkrétního žadatele o kotaci

Příklad 142

Investiční podnik Y odpoví na žádost o kotaci Investičního podniku X z příkladu 141 výše tím, že zareaguje jednostrannou poptávkou (podáním) za 8,750 EUR na požadovaný objem (1000) u nástroje ISIN XX0000000000 dne 27. června 2018 ve 13:06:07(UTC), která je platná 10 minut a vykonatelná žadatelem o kotaci, Investičním podnikem X. Reakce na kotaci je rozpoznatelná, protože v události pokynu (pole 21) se vyplní „RFQR“. Spojení mezi žadatelem o kotaci a reagujícím na kotaci se provede

⁴⁷ Tento kód není uveden v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580, ale spadá do pole s volným formátem {ALPHANUM-4}. Od obchodních systémů se však očekává, že budou tento konkrétní kód používat pro tento konkrétní případ.

tak, že v poli Omezení pokynů (pole 11) se vyplní identifikační kód pokynu, který je zaznamenaný v obchodním systému žádostí o kotace v příslušné žádosti o kotaci (viz příklad 141).

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl A – Identifikace příslušných stran		
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	ABCDEFGHIJKLMNQRST
Oddíl C – Datum a čas		
9	Datum a čas	2018-06-27T13:06:07Z
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
10	Doba platnosti	GTSV
11	Omezení pokynů	123456789ABC
12	Datum a čas doby platnosti	2018-06-27T13:16:07Z
Oddíl F – Identifikace pokynu		
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000
20	Identifikační kód pokynu	23456789DEF
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	RFQR ⁴⁸
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	8,750
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	1000

6.14.3 Jak zaznamenat reakci na kotaci s odlišným množstvím, než bylo požadováno.

Příklad 143

Investiční podnik Z reaguje na žádost o kotaci z příkladu 141 tím, že zveřejní jednostrannou poptávku (podání) za 8,750 EUR na odlišný objem z požadovaného objemu (Investiční podnik X požadoval 1000, Investiční podnik Z reaguje 600) u nástroje ISIN XX0000000000, která je vykonatelná žadatelem o kotaci, Investičním podnikem X. Spojení mezi žadatelem o kotaci a reagujícím na kotaci se provede

⁴⁸ Tento kód není uveden v RTS, ale spadá do pole s volným formátem {ALPHANUM-4}. Od obchodních systémů se však očekává, že budou tento konkrétní kód používat pro tento konkrétní případ.

tak, že v poli Omezení pokynů (pole 11) se vyplní identifikační kód pokynu, který je zaznamenaný v obchodním systému žádostí o kotace v příslušné žádosti o kotaci (viz příklad 141).

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl A – Identifikace příslušných stran		
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	KLMNOPQRST1234567890
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
11	Omezení pokynů	123456789ABC
Oddíl F – Identifikace pokynu		
18	Identifikační kód finančního nástroje	XX0000000000
20	Identifikační kód pokynu	78901223GHI
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	RFQR ⁴⁹
Oddíl H – Typ pokynu		
22	Typ pokynu	Limit
23	Klasifikace typu pokynu	LMTO
Oddíl I – Ceny		
24	Limitní cena	8,750
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI
36	Původní množství	600

6.14.4 Jak zaznamenat provedení v systému žádostí o kotace

Příklad 144

Žadatel o kotaci, Investiční podnik X, reaguje na kotaci poskytnutou Investičním podnikem Y z příkladu 142. Obchod z ní vycházející je zobrazen jako dvě události provedené žadatelem o kotaci, Investičním podnikem X, a reagujícím na kotaci, Investičním podnikem Y. Identifikační kód obchodů v obchodním systému (pole 48) se vyplní při každé z těchto událostí, aby ukazoval obě kotace, které jsou zapojené do obchodu. Tímto způsobem lze vytvořit úplnou auditní stopu od žádosti o kotaci přes odpovídající reakci na kotaci po odpovídající obchod. První tabulka ukazuje událost provedení žádosti o kotaci pro Investiční podnik X:

⁴⁹ Tento kód není uveden v RTS, ale spadá do pole s volným formátem {ALPHANUM-4}. Od obchodních systémů se však očekává, že budou tento konkrétní kód používat pro tento konkrétní případ.

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl A – Identifikace příslušných stran		
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	12345678901234567890
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
11	Omezení pokynů	
Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	123456789ABC
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	FILL
Oddíl I – Ceny		
28	Cena obchodu	8,750
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	SELL
39	Obchodované množství	1000
47	Strategie směřování	ABCDEFGHIJKLMNQRST
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	GHIJ1234

Druhá tabulka ukazuje událost provedení žádosti o kotaci pro Investiční podnik Y:

Č.	Pole	Normy a formát údajů předkládaných příslušným orgánům na jejich žádost
Oddíl A Identifikace příslušných stran		
1	Identifikace subjektu, který předal pokyn	ABCDEFGHIJKLMNQRST
Oddíl D – Doba platnosti a omezení pokynů		
11	Omezení pokynů	123456789ABC
Oddíl F – Identifikační kód pokynu		
20	Identifikační kód pokynu	23456789DEF
Oddíl G – Události mající vliv na pokyn		
21	Nový pokyn, změna, zrušení, zamítnutí, částečné a úplné provedení	FILL
Oddíl I – Ceny		
28	Cena obchodu	8,750
Oddíl J – Instrukce týkající se pokynů		
32	Indikátor nákupu/prodeje	BUYI

39	Obchodované množství	1000
47	Strategie směřování	
48	Identifikační kód obchodů v obchodním systému	GHIJ1234

7 Obecné pokyny k synchronizaci obchodních hodin

Článek 50 směrnice MiFID II a související regulační technické normy se vztahují na obchodní systémy a jejich členy a účastníky a vyžadují od nich, aby dodržovali požadavky na přesnost, pokud jde o maximální odchylku jejich obchodních hodin od koordinovaného světového času (UTC), a aby události, které musí být nahlášeny, opatřovali časovým razítkem s konkrétní podrobností.

7.1 Události, které musí být nahlášeny

Článek 50 směrnice MiFID II odkazuje na povinnost obchodních systémů a jejich členů/účastníků synchronizovat obchodní hodiny, které používají k zaznamenávání data a času každé „události, která musí být nahlášena“. ESMA považuje za relevantní poskytnout příklady „událostí, které musí být nahlášeny“ pro účely článku 50.

ESMA má za to, že „událost, která musí být nahlášena“ zahrnuje některou z následujících povinností:

- Uveřejnění času obchodování a času uveřejnění, jak předepisuje příloha I, tabulka 3 RTS 1 a příloha II tabulky 1b RTS 2 o transparentnosti u akciových nástrojů, nástrojů podobných akciovým a neakciovým nástrojů podle článků 6, 7, 10 a 11 nařízení MiFIR;
- Uvedení času obchodování v hlášení obchodů, jak předepisuje pole 28 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 podle článku 26 nařízení MiFIR;
- Vedení záznamů o čase událostí majících vliv na pokyny a obchody prováděné investičními podniky podle čl. 25 odst. 1 nařízení MiFIR a požadavky na vedení záznamů (jiných než záznamů telefonních hovorů nebo jiné elektronické komunikace), které vycházejí z čl. 16 odst. 6 směrnice MiFID II, jak předepisuje článek 74 delegovaného nařízení Komise (EU) 2017/565 ze dne 25. 4. 2016 (požadavky čl. 16 odst. 6 směrnice MiFID II);
- Vedení záznamů o čase ve vztahu k událostem majícím vliv na pokyny uvedeným v poli 27 tabulky 2 a polích 23, 24 a 33 tabulky 3 přílohy II RTS 6 podle čl. 17 odst. 2 směrnice MiFID II pro investiční podniky používající způsoby algoritmického obchodování s vysokou frekvencí;
- Vedení záznamů o čase ve vztahu k událostem majícím vliv na pokyny uvedeným v polích 9, 12, 13 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 podle čl. 25 odst. 2 nařízení MiFIR.

7.2 Podrobnost časového razítka

Článek 50 směrnice MiFID II se vztahuje na širokou škálu událostí, které musí být nahlášeny (oddíl 7.1). Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 specifikuje dva typy požadavků na přesnost: maximální odchylku od UTC a podrobnost časového razítka. Tento oddíl obecných pokynů se týká pouze druhého požadavku.

Je třeba upozornit, že článek 50 směrnice MiFID II se vztahuje pouze na události, které musí být nahlášeny a k nimž dochází v obchodním systému. Nevztahuje se například na obchody OTC.

Člen nebo účastník obchodního systému se nemusí řídit stejnými požadavky na časová razítka, která platí pro obchodní systém, jehož je členem nebo účastníkem. Člen nebo účastník používá časové razítko pouze podle požadavků, které se vztahují na obchodní činnost jeho společnosti podle článku 50 směrnice MiFID II.

V případě, kdy je obchod proveden prostřednictvím řetězce investičních podniků (takže původní pokyn se předává v řetězci od jednoho investičního podniku k druhému), každý investiční podnik v řetězci dodržuje požadavky na časové razítko platné pro jeho vlastní obchodní činnost bez ohledu na požadavky na časové razítko platné pro ostatní investiční podniky v řetězci.

Ustanovení čl. 26 nařízení MiFIR a čl. 16 odst. 6 směrnice MiFID II – Hlášení obchodů a vedení záznamů o obchodech a zpracování pokynů

7.2.1.1 Obchody provedené v obchodním systému

Pokud investiční podnik provede obchod v obchodním systému (např. jako člen nebo účastník obchodního systému), hlásí pole Datum a čas obchodování v hlášení o obchodu s využitím úrovně podrobnosti uvedené v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 pro obchody prováděné v obchodním systému. Ta je stanovena v oddílu 5.4 „Provádění obchodu v obchodním systému“ v části I těchto obecných pokynů. Podobně také investiční podniky, na které se vztahují požadavky čl. 16 odst. 6 směrnice MiFID II zaznamenávají čas obchodů provedených v obchodním systému a pokynů zadaných do obchodního systému s využitím stejných podrobností, jaké uvádí nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574.

7.2.1.2 Obchody neprovedené v obchodním systému

Všechny investiční podniky (bez ohledu na to, zda jde o člena nebo účastníka obchodního systému) používají časové razítko u svých hlášení o obchodech s podrobností na sekundy nebo lepší podle pole 28 tabulky 2 přílohy I nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 pro obchody neprováděné v obchodním systému. Podobně také investiční podniky, na které se vztahují požadavky čl. 16 odst. 6 MiFID II, zaznamenávají čas obchodů neprovedených v obchodním systému a pokynů, které nejsou zadávány do obchodního systému, na nejbližší sekundu.

U obchodů neprováděných v obchodním systému (tj. obchodů OTC) uvádí nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, že datum a čas v hlášení o obchodu je datem a časem, „kdy se strany dohodnou na obsahu některých polí“.

7.2.1.3 Příklady

Následující příklady ukazují, jak používat časové razítko u údajů v pokynech a v hlášeních o obchodech. Je třeba upozornit, že vzhledem k tomu, že časy jsou v UTC+1, upraví se časová razítka na čas UTC. V následujících příkladech se má za to, že Investiční podnik X a Investiční podnik Y jsou investičními podniky, které mají oznamovací povinnost podle článku 26 nařízení MiFIR.

Příklad 145: Pokyny a obchody v obchodním systému

Investiční podnik X přijme dne 20. června 2018 pokyn na hotovostní akciový nástroj od zákazníka prostřednictvím elektronické zprávy ve 12:11:38.077312(UTC+1). Investiční podnik X automaticky zpracuje tuto zprávu a použije svůj algoritmus, který zadá pokyn do Obchodního systému M ve 12:11:38.236931(UTC+1). Obchodní systém M přijme pokyn ve 12:11:38.478598(UTC+1) (pokyn 1). Investiční podnik X se zapojil do techniky algoritmického obchodování s vysokou frekvencí ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 40 směrnice (EU) 2014/65, MiFID II, ve vztahu k tomuto pokynu.

Investiční podnik Y zadává pokyn dne 20. června 2018 na hotovostní akciový nástroj do Obchodního systému M ve 13:42:29.327087 (UTC+1). Pokyn je přijat Obchodním systémem M ve 13:42:29.561123 (UTC+1)(pokyn 2). Investiční podnik Y používá elektronický systém, který nespadá do definice čl. 4 odst. 1 bodu 40 směrnice (EU) 2014/65/EU, MiFID II.

Latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu Obchodního systému M u tohoto elektronického systému párování je 350 mikrosekund.

Ustanovení čl. 25 nařízení MiFIR a článku 17 směrnice MiFID II – vedení údajů o pokynech

Obchodní systém M zaznamená událost pokynu s podrobností na mikrosekundy nebo lepší, protože jeho latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu je menší než 1 milisekundu. U pokynu 1 se v poli 9 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 vyplní 2018-06-20T11:11:38.478598Z a u pokynu 2 se v poli 9 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 vyplní 2018-06-20T12:42:29.561123Z.

Investiční podnik X zaznamená událost pokynu s podrobností na mikrosekundy nebo lepší, protože činnost vytvořil Investiční podnik X pomocí techniky algoritmického obchodování s vysokou frekvencí (viz tabulka 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574). Časové razítko použité pro to, kdy byl přijat pokyn od klienta, bude 2018-06-20T11:11:38.077312Z. Časové razítko použité pro to, kdy byl pokyn zadán do obchodního systému, bude 2018-06-20T11:11:38.236931Z.

Investiční podnik Y zaznamená událost pokynu s podrobností na milisekundy nebo lepší, protože tato činnost byla provedena s využitím elektronického obchodování, které spadá do posledního řádku tabulky 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 jako „jakákoli jiná obchodní činnost“. Časové razítko bude 2018-06-20T12:42:29.327Z.

Ustanovení článku 26 nařízení MiFIR – hlášení obchodů

Pokud byly pokyny Investičního podniku X a Investičního podniku Y provedeny v obchodním systému, předloží podnik X a podnik Y hlášení o obchodech.

Investiční podnik X vyplní pole 28 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (Datum a čas obchodování) u hlášení o obchodu ukazujícího provedení na trhu s podrobností na mikrosekundy nebo lepší. Investiční podnik Y u hlášení obchodu ukazujícího provedení na trhu použije podrobnost na milisekundy nebo lepší.

Příklad 146: Obchody neprovedené v obchodním systému

Pokračování příkladu 145: Pokud předpokládáme, že Investiční podnik X nabyl hotovostní akciový nástroj v obchodním systému M a pokud investiční podnik poté prodal tento nástroj svému zákazníkovi, předloží Investiční podnik X hlášení o obchodu. Podle pole 28 Datum a čas obchodování tabulky 2

přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 vyplní investiční podnik datum a čas obchodování ve svém hlášení o obchodu s podrobností na sekundy nebo lepší.

Příklad 147: Pokyny a obchody v obchodním systému

Investiční podnik X zadal pokyn na globální cenný papír nahrazující jiné cenné papíry do Obchodního systému A v 15:01:25.369310(UTC+1) dne 20. června 2018, který Obchodní systém A přijal v 15:01:25.458482.

V tomto případě se v Obchodním systému A používá jiný elektronický systém párování než v příkladu 116. Latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu u tohoto systému párování je 1,2 milisekundy.

Investiční podnik X použil pro zadání pokynu elektronický systém, který nespadá do definice čl. 4 odst. 1 bodu 40 směrnice MiFID II.

Ustanovení čl. 25 nařízení MiFIR a článku 17 směrnice MiFID II – vedení údajů o pokynech

Obchodní systém A zaznamená událost pokynu s podrobností na milisekundy nebo lepší, protože jeho latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu je větší než 1 milisekundu. V poli 9 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 se vyplní 2018-06-20T14:01:25.458Z.

Investiční podnik X zaznamená událost pokynu s podrobností na milisekundy nebo lepší, protože tato činnost byla vytvořena s využitím elektronického obchodování, které spadá do posledního řádku tabulky 2 přílohy nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 jako „jakákoli jiná obchodní činnost“. Časové razítko bude 2018-06-20T14:01:25.369Z.

Ustanovení článku 26 nařízení MiFIR – hlášení obchodů

Pokud byl pokyn Investičního podniku X proveden v Obchodním systému A, vyplní Investiční podnik X pole 28 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (Datum a čas obchodování) u hlášení o obchodu ukazujícího provedení na trhu s podrobností na milisekundy nebo lepší.

U řetězce s koncovým provedením v obchodním systému musí být pouze hlášení čelící trhu v obchodním systému předloženo s podrobností stanovenou v článku 3 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 a u ostatních hlášení se požadují pouze sekundy, ačkoli podrobnost hlášení může být i lepší. Investiční podniky, které zadávají pokyny jiným podnikům, mohou hlásit čas provedení v poli Datum a čas obchodování, který jim sdělí provádějící podnik pomocí hlasové nebo elektronické zprávy.

7.3 Dodržení požadavků na maximální odchylku

Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 specifikuje dva typy požadavků na přesnost: maximální odchylku od UTC a podrobnost časového razítka. Tento oddíl obecných pokynů se týká pouze prvního požadavku. Ustanovení článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 uvádí, že „Organizátoři obchodních systémů a jejich členové nebo účastníci zavedou systém zajišťující návaznost na UTC“. K tomu je třeba zajistit, aby jejich systém pracoval s podrobností a maximální tolerovanou odchylkou od UTC podle nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. Organizátoři obchodních systémů a jejich členové nebo účastníci dále dokládají, že používané klíčové systémové součásti vyhovují standardní míře přesnosti u podrobností a maximální odchylky od UTC,

jak zaručuje a specifikuje výrobce těchto systémových součástí (specifikace součástí splňují požadovanou míru přesnosti) a že tyto systémové součásti jsou nainstalovány ve shodě s pokyny výrobce pro instalaci.

Vyžaduje se relevantní a přiměřené testování systému společně s jeho relevantním a přiměřeným monitorováním, aby se zajistilo, že odchylka od UTC zůstane v mezích tolerance. Relevance a přiměřenost budou záviset na použité maximální odchylce od UTC.

Podle článku 1 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 jsou systémy, které zajišťují přímou návaznost na čas UTC, který vydávají a udržují časová centra uvedená v poslední výroční zprávě o činnosti v oblasti času Mezinárodního úřadu pro váhy a míry, považovány za přípustné k zaznamenávání událostí, které musí být nahlášeny. Používání zdrojů času amerického globálního polohového systému (GPS) nebo jiného globálního družicového navigačního systému, jako je například ruský GLONASS nebo evropský družicový systém Galileo, až bude uveden do provozu, je rovněž přípustné k zaznamenávání událostí, které musí být nahlášeny, pokud je jakákoli odchylka od UTC zohledněna a odstraněna z časového razítka. Čas GPS se liší od UTC. Časová zpráva GPS však také obsahuje odchylku od UTC (přestupné sekundy) a tato odchylka se kombinuje s časovým razítkem GPS pro získání časového razítka v souladu s požadavky na maximální odchylku v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. Uživatelé těchto systémů si musí být vědomi příslušných rizik souvisejících s jejich používáním, jako jsou sluneční erupce, interference, rušení nebo mnohocestné odrazy, a dbát na to, aby byl přijímač správně fixován na signál. Proto se podniknou vhodné kroky, aby byla tato rizika minimalizována. Subjekty, které plánují používat přijímače GPS, na něž se budou vztahovat přísnější požadavky na přesnost, zvaží zejména doporučení pro radiovou komunikaci Mezinárodní telekomunikační unie (ITU-R) TF.1876 o zdroji důvěryhodného času⁵⁰.

Pro účely článku 4 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 se pro uživatele satelitního systému přesnost vyžadovaná podle RTS použije v libovolném místě v rámci hranic systému domény, kde se měří čas. Prvním místem, kde se zvažuje konstrukce, fungování a specifikace systému, je použitý přijímač (např. model přijímače GPS a výpočtová přesnost přijímače GPS) pro získání zprávy s časovým razítkem ze satelitu (a související antény). Nepatří sem návaznost družicového systému GPS a družic na UTC.

7.3.1 Přestupné sekundy

Pokud se má k UTC přičíst nebo od něj odečíst přestupná sekunda, jak pravidelně oznamuje Mezinárodní služba pro rotaci země a referenční systémy (IERS), provádí se to v souladu s doporučením pro radiovou komunikaci Mezinárodní telekomunikační unie (ITU-R) TF.460-6. Toto doporučení uvádí, že kladná přestupná sekunda začíná v 23:59:60 a končí v 00:00:00 a záporná přestupná sekunda je znázorněna pohybem času z 23:59:58 na 00:00:00.

7.3.2 Místní čas a odchylka od UTC

Časová razítka mohou být vedena v místním čase, pokud je při poskytování údajů příslušnému orgánu časové razítko převedeno na UTC (čas „zulu“). Některé zprávy časového razítka mohou obsahovat časové razítko a odchylku od UTC platnou pro dané časové razítko. U časových razítek poskytovaných

⁵⁰ Doporučení TF.1876-0 (04/2010), k dispozici na <https://www.itu.int/rec/R-REC-TF.1876-0-201004-l/en>.

příslušnému orgánu se použije odchylka, aby se příslušnému orgánu předávalo pouze jedno časové razítko.

7.3.3 Platnost pro investiční podniky, které nejsou přímými členy ani účastníky obchodního systému

Článek 50 směrnice MiFID II platí pouze pro obchodní systémy a jejich členy nebo účastníky. Požadavky nařízení MiFIR, RTS 6 a čl. 16 odst. 6 směrnice MiFID II se vztahují na investiční podniky bez ohledu na to, zda vystupují jako členové nebo účastníci obchodního systému. Má se za to, že odkazy na požadavky na maximální odchylku v těchto dvou nařízeních platí pouze pro investiční podniky, pokud jednají jako členové nebo účastníci obchodních systémů, protože to je v souladu s oblastí působnosti povinností definovaných v textu úrovně 1.

7.4 Aplikační, hostitelská a „drátová“ časová razítka

Aplikační a hostitelská časová razítka jsou generována v softwarové aplikaci, kdežto „drátová“ časová razítka generuje samostatný hardware, který současně pořizuje kopii síťových paketů obsahujících příslušné informace. ESMA má za to, že je přípustné, aby členové nebo účastníci používali kterékoli z těchto časových razítek. Obchodní systémy je třeba upozornit, že vzhledem k požadavkům na zaznamenávání událostí v systému párování bude pravděpodobně zapotřebí používat aplikační časová razítka.

7.5 Latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu

Obchodní systémy mohou uvádět více latencí mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu pro různé percentily. Pro účely synchronizace obchodních hodin má ESMA za to, že obchodní systémy používají latenci mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu v 99. percentilu.

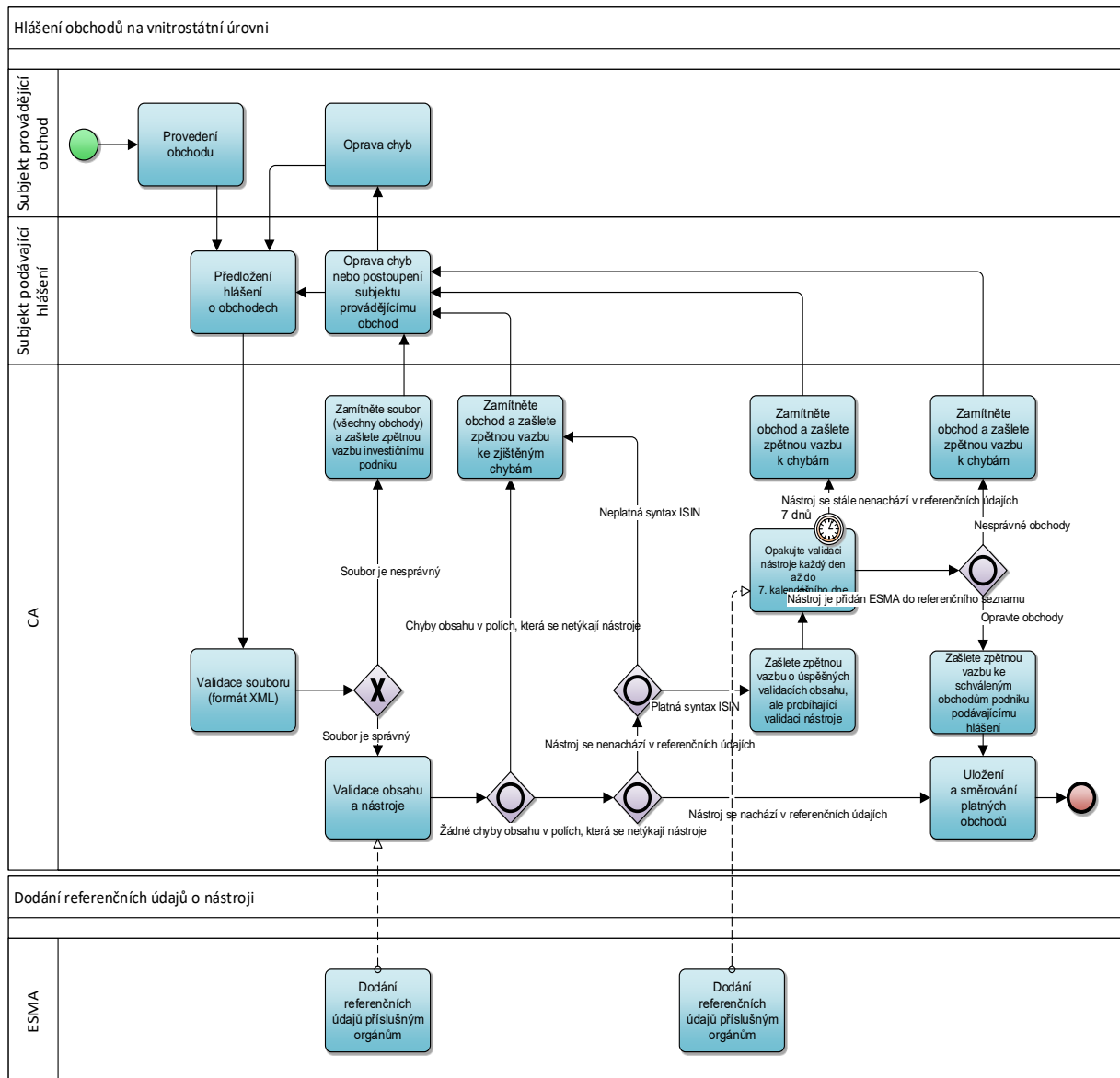
Obchodní systémy mají povinnost sledovat v reálném čase latenci mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu podle čl. 13 písm. c) (ESMA/2015/1464)⁵¹. Pokud se latence mezi vstupem a výstupem zprávy přes bránu zlepší z více než 1 milisekundy na méně než jednu milisekundu nebo rovno jedné milisekundě, potom se změní jejich požadavky podle článku 50 na podrobnost a maximální odchylku. K tomuto typu scénáře s největší pravděpodobností dojde po přechodu na nový systém párování nebo technologických vylepšení stávající infrastruktury systému, a proto se při plánování takové práce zvažují požadavky na časové razítko.

⁵¹ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/584 ze dne 14. 7. 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o regulační technické normy upřesňující organizační požadavky na obchodní systémy.

8 Přílohy

Příloha I Zpracování hlášení přijatých od předkládajících subjektů

Následující schéma znázorňuje proces hlášení obchodů na vnitrostátní úrovni:



Následující tabulka shrnuje termíny pro klíčové události v procesu:

Notace	Úkol	Termín
T	Provedení obchodu	

R	Předložení hlášení o obchodech vykazujícím subjektem	T+1 pracovní den
	Poskytnutí zpětné vazby vykazujícím subjektům	R+1 kalendářní den (R+7 v případě nástroje scházejícího v referenčních údajích)

Obchody provedené v den T se hlásí nejpozději do konce následujícího pracovního dne, tj. T+1.

Je ponecháno na rozhodnutí každého příslušného orgánu, aby předepsal podrobné technické postupy a časové harmonogramy pro předkládání hlášení.

Příslušný orgán validuje příchozí zprávy následujícím způsobem:

Validace souboru – ověření souladu souboru s formátem XML (syntax celého souboru a specifických hlášení o obchodech). Pokud není soubor v souladu, je celý soubor (všechny obchody zařazené do souboru) zamítnut.

Validace obsahu – soubor validačních pravidel, která se provádí u každého hlášení o obchodu a která ověřují obsah specifických polí. Nesprávná hlášení o obchodech jsou zamítnuta, zatímco správná hlášení jsou zpracována v dalších krocích. Tato validační pravidla obsahují validace v závislosti na referenčních údajích nástroje.

Každý příslušný orgán používá validace souborů. Tato validační pravidla kontrolují správnost syntaxe souboru XML.

Po úspěšné validaci souboru se provedou u každého hlášení o obchodu zahrnutého do souboru všechna pravidla pro validaci obsahu. Obsahová pravidla obsahují zejména validaci, zda samotný nástroj nebo podkladový nástroj (v případě některých obchodů OTC nebo obchodů s derivátovými nástroji prováděnými na organizované obchodní platformě mimo Unii), pro který se obchod prováděl, je zahrnut v referenčních údajích a zda nahlášený kód ISIN je správný z hlediska syntaxe / kontrolního součtu. Mohou se zvážit následující případy:

Pokud je hlášení o obchodu správné (všechna obsahová pravidla jsou v pořádku) a nahlášený nástroj existuje v referenčních údajích → hlášení o obchodu je přijato;

Pokud neexistují žádné obsahové chyby ve vztahu k polím jiným než nástroj / podkladový nástroj, ale nahlášený nástroj schází v referenčních údajích a syntax / kontrolní součet nahlášeného ISIN je správná → provedou se následující kroky:

příslušný orgán informuje předkládající podnik, že u hlášení probíhá validace nástroje;

příslušný orgán provádí validaci nástroje každý den až do 7. kalendářního dne po přijetí hlášení od předkládajícího podniku;

pokud se nástroj objeví v referenčních údajích před uplynutím 7 kalendářních dnů a pokud neexistují žádné obsahové chyby v důsledku validace nástroje, je obchod přijat;

pokud se nástroj objeví v referenčních údajích před uplynutím 7 kalendářních dnů a vyskytnou se obsahové chyby v důsledku validace nástroje, je obchod zamítnut;

pokud po 7 kalendářních dnech nástroj stále neexistuje v referenčních údajích, příslušný orgán zamítne hlášení o obchodu a zašle příslušnou zprávu předkládajícímu podniku;

pokud neexistují žádné obsahové chyby ve vztahu k polím jiným než nástroj / podkladový nástroj, ale nahlášený nástroj schází v referenčních údajích a kontrolní součet nahlášeného ISIN je nesprávný → obchod je okamžitě zamítnut;

pokud existují obsahové chyby ve vztahu k polím jiným než nástroj / podkladový nástroj → obchod je okamžitě zamítnut, tj. bez čekání dalších 7 dnů. Poskytne se zpětná vazba ke všem identifikovaným chybám.

Validace obsahu se použije pouze u souborů, které úspěšně prošly validací na úrovni souboru. Každé z validačních pravidel se použije na každé hlášení o obchodu v souboru.

Pokud není hlášení o obchodu v souladu s jedním nebo více validačními pravidly, takové hlášení se zamítne. Hlášení, která vyhovují validačním pravidlům, jsou přijata. Může se stát, že některá hlášení o obchodu obsažená v jednom souboru jsou přijata a jiná jsou zamítnuta. Ve světle posledního pododstavce čl. 26 odst. 7 nařízení MiFIR zareaguje subjekt podávající hlášení bezodkladně na každé zamítnutí a zajistí opravu chyb bez zbytečného prodlení. Při validaci obchodů provedených v den T používá příslušný orgán referenční údaje ze dne T. Aby bylo možno řešit problémy související s pozdním hlášením obchodů nebo referenčními údaji, u obchodů validovaných nebo směřovaných na později než v den T+1, použijí příslušné orgány nejnovější referenční údaje dostupné v den provádění validace, např. pokud obchod, který byl proveden v den T, je přijat od investičního podniku v den T+10, validuje se tento obchod pomocí nejnovějších referenčních údajů dostupných v den validace.

Soubory se zpětnou vazbou se vytvoří a zašlou předkládajícím subjektům nejpozději v den následující po předložení hlášení (tj. R+1, kdy R je den hlášení). Sem patří potvrzení správného předložení hlášení o obchodech i chybová hlášení v případě, že jsou předložena hlášení o obchodech nebo celé soubory nesprávná. Pokud je hlášení o obchodu zamítnuto, ve zpětné vazbě se uvede validační pravidlo, které bylo provedeno, a povaha chyby.