

part of eex group



Durchführungsbestimmung zu Auftragsdaten

26.03.2024
Leipzig

Ref. 002b

Inhaltsverzeichnis

1.	Allgemeines	4
1.1	Geltungsbereich	4
1.2	Qualität der Auftragsdaten	4
1.3	EEX Member Portal	4
1.4	Änderungen	5
1.5	Technische Dokumentation	5
2.	Auftragsdaten	6
2.1	Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat	6
2.2	Direkter elektronischer Zugang (DEA)	6
2.3	Kundenidentifikationscode	6
2.4	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	6
2.5	Ausführung innerhalb der Firma	8
2.6	Nicht ausführender Makler	9
2.7	Handelsbezogene Funktion	9
2.8	Liquiditätszufuhr	10
2.9	Datum und Uhrzeit	10
2.10	Gültigkeitsdauer	11
2.11	Auftragsbeschränkung	11
2.12	Datum und Uhrzeit der Gültigkeitsdauer	11
2.13	Zeitstempel zur Priorisierung von Aufträgen	12
2.14	Prioritätsvolumen	12
2.15	Laufende Nummer	12
2.16	Segment MIC	12
2.17	Orderbuch-Code	12
2.18	Identifikationscode des Finanzinstruments	12
2.19	Eingangsdatum	12
2.20	Auftragsidentifikationscode	12
2.21	Ereignisse mit Auswirkungen auf den Auftrag	12
2.22	Auftragsart	12
2.23	Klassifizierung der Auftragsart	12
2.24	Limitpreis	13

2.25	Weiterer Limitpreis	13
2.26	Stop-Preis	13
2.27	Pegged-Limitpreis	13
2.28	Transaktionspreis	13
2.29	Währung des Preises	13
2.30	Währung von Leg 2	13
2.31	Preisnotierung	13
2.32	Kauf/Verkauf-Indikator	13
2.33	Auftragsstatus	14
2.34	Mengennotierung	14
2.35	Währung der Menge	14
2.36	Anfangsmenge	14
2.37	Restmenge einschließlich nicht sichtbaren Teils	14
2.38	Angezeigte Menge	14
2.39	Gehandelte Menge	14
2.40	Minimum Acceptable Quantity (MAQ)	14
2.41	Minimum Executable Size (MES)	14
2.42	MES nur erste Ausführung	15
2.43	Kennzeichen für nur passiv	15
2.44	Kennzeichen für passiv oder aggressiv	15
2.45	Self-Execution Prevention	15
2.46	Identifikationscode für Strategieorder	15
2.47	Weiterleitungsstrategie	15
2.48	Vom Handelsplatz vergebener Transaktionsidentifikationscode	15
2.49	Handelsphasen	15
2.50	Indikativer Auktionspreis	15
2.51	Indikatives Auktionsvolumen	15
3.	Weitere Auftragsdaten	16
3.1	Risikoindikator bei Warenderivaten	16
3.2	MCM-Ausnahme bei EEX Natural Gas Derivaten	16

1. Allgemeines

1.1 Geltungsbereich

Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 („MiFIR“) verpflichtet die European Energy Exchange (EEX), die einschlägigen Daten über sämtliche Aufträge für Finanzinstrumente, die über ihre Systeme mitgeteilt werden, für mindestens fünf Jahre aufzuzeichnen. Die Aufzeichnungen sollen insbesondere die Einzelheiten enthalten, die für aus einem Auftrag resultierende Geschäfte nach Artikel 26 Absätze 1 und 3 MiFIR an die zuständige Behörde zu übermitteln sind.

Nach § 26g Börsengesetz („BörsG“) und § 67 Absatz 2 Börsenordnung ist die Börsengeschäftsführung berechtigt, zum Zweck der Aufzeichnung von Auftragsdaten nach Art. 25 Abs. 2 MiFIR in Verbindung mit den einschlägigen Bestimmungen der Delegierten Verordnung (EU) 2017/580 und der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590, die Übermittlung von Daten zu verlangen.

Die Börsengeschäftsführung legt mit dieser Durchführungsbestimmung fest, welche Daten mit einem Auftrag für Finanzinstrumente an die EEX zu übermitteln sind. Eingabe im Rahmen der Registrierung von Geschäften über Finanzinstrumente stehen Aufträgen gleich. Finanzinstrumente sind die an der EEX und dem EEX OTF handelbaren Produkte, die von der Definition in § 2 Abs. 4 des Wertpapierhandelsgesetzes („WpHG“) erfasst sind.

Diese Durchführungsbestimmung gilt auch für Eingaben in die Handelssysteme, die die Börse auf Grund konkreter Weisung eines Börsenteilnehmers oder Non-Trading Brokers („beauftragende Person“) in dessen Auftrag nach § 13 der Handelsbedingungen für diesen vornimmt („Trading on Behalf“). Die Börse wird hierbei den Auftrag und die damit übermittelten Informationen so in das Handelssystem übertragen, wie sie von der beauftragenden Person bereitgestellt werden. Die Erfüllung der Vorgaben dieser Durchführungsbestimmung über die mit einem Auftrag nach Abschnitt 2 einzugebenden Informationen bleibt die alleinige Verantwortung der beauftragenden Person.

Diese Durchführungsbestimmung gilt nicht für Aufträge am EEX Natural Gas Spot Markt und Gebote in der Primärauktion von Zertifikaten.

1.2 Qualität der Auftragsdaten

Der Börsenteilnehmer hat sicherzustellen, dass alle von ihm mitgeteilten und übermittelten Auftragsdaten richtig, vollständig und in sich konsistent sind und den Bestimmungen dieser Durchführungsbestimmung entsprechen. Insbesondere hat der Börsenteilnehmer bei Auftragseingabe eines seiner Eigen- oder Kundenpositionskonten in Abhängigkeit davon zu benennen, ob er für sich selbst oder im Auftrag von Kunden an der EEX handelt.

1.3 EEX Member Portal

Soweit die Verwendung von Short Codes nach dieser Durchführungsbestimmung vorgesehen ist, hat der Börsenteilnehmer der EEX die von ihm bei der Auftragseingabe verwendeten Short Codes mit den jeweiligen Long Codes und ggf. die den jeweiligen Long Code spezifizierenden Angaben über das für die EEX betriebene Member Portal (Member Section - Deutsche Börse Group (deutsche-boerse.com)) mitzuteilen. Die Implementierung der Short Codes hat als positive, ganzzahlige Werte mit maximal 19

Ziffern ({INTEGER⁺-19}-Format) zu erfolgen. Die einschlägigen Informationen müssen der EEX spätestens am Geschäftstag nach der Auftragseingabe über das Member Portal mitgeteilt sein.

Für die technische Benutzung des Member Portals sowie die Registrierung wird auf das Handbuch *MiFID II – Registration of “short codes” via the Upload Function* in der jeweils geltenden Fassung hingewiesen.

1.4 Änderungen

Der Börsenteilnehmer hat die EEX unverzüglich über jede Änderung seiner der EEX mitgeteilten Stammdaten (einschließlich Short und Long Codes nach Abschnitt 1.3) in der jeweils von EEX vorgegebenen Form und Frist zu informieren.

1.5 Technische Dokumentation

Für die technische Umsetzung der Anforderungen dieser Durchführungsbestimmung wird auf die T7-spezifischen Abschnitte des Handbuchs *Information handbook for audit trail, transaction and other regulatory reporting under the MiFID II / MiFIR regime* der EUREX und Frankfurter Wertpapierbörse in seiner jeweils geltenden Fassung sowie die Handbücher *Enhanced Trading Interface – Derivatives Message Reference* und *FIX LF – Interface Derivatives Message Reference* zum jeweils aktuellen T7 Release (hier unter „T7 Release“ im Bereich „Trading Interfaces“ zum Download verfügbar) hingewiesen. Bei Abweichungen der vorgenannten Handbücher von den Anforderungen dieser Durchführungsbestimmung gehen die Bestimmungen dieser Durchführungsbestimmung vor.

Bei Rückfragen wenden Sie sich bitte an Ihren Key Account Manager.

2. Auftragsdaten

Die Reihenfolge, Nummerierung und Bezeichnung der folgenden Unterabschnitte entsprechen der Reihenfolge, Nummerierung und Bezeichnung der Felder der Tabelle 2 im Anhang der Delegierten Verordnung (EU) 2017/580. Die Felder sind nur zu dem nach der Delegierten Verordnung (EU) 2017/580 bestimmten Zweck und nach Maßgabe dieser Durchführungsbestimmung zu befüllen.

2.1 Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat

Die Identifikation des Unternehmens (Börsenteilnehmer), das den Auftrag eingereicht hat oder in dessen Namen ein Auftrag eingereicht wurde, erfolgt über die Member ID des Börsenteilnehmers und ist bei der EEX mit dem Legal Entity Identifiers („LEI“) des Börsenteilnehmers verknüpft, der der EEX im Rahmen der Zulassung mitgeteilt wurde.

2.2 Direkter elektronischer Zugang (DEA)

Die Kennzeichnung eines Auftrages, der über einen direkten elektronischen Zugang im Sinne von Abschnitt 1.8 der Technischen Durchführungsbestimmungen („DEA“) an die EEX übermittelt wurde, erfolgt über die gesondert zugewiesene Nutzerkennung des Zugangs zum Handelssystem (z.B. DMA001). Hierfür ist die vorherige Anzeige der beabsichtigten Einräumung von DMA nach Abschnitt 2.5 der Technischen Durchführungsbestimmungen bzw. die vorherige Erlaubnis durch die EEX nach Abschnitt 2.6 der Technischen Durchführungsbestimmungen für die Einräumung eines Sponsored Access, erforderlich.

2.3 Kundenidentifikationscode

Das Feld „Client ID“ ist zu befüllen, wenn der Börsenteilnehmer im Auftrag von Kunden an der EEX handelt.

Die Identifikation eines Kunden des Börsenteilnehmers erfolgt über die Eingabe des jeweiligen Short Codes (Client Identification Code). Dieser Short Code muss mit dem Short Code übereinstimmen, den der Börsenteilnehmer der EEX für diesen Kunden zuvor zusammen mit der dazugehörigen LEI (bei juristischen Personen) oder NATIONAL_ID (bei natürlichen Personen) des Kunden mitgeteilt hat.

Im Falle eines direkten elektronischen Zugangs ist der Short Code des DEA-Nutzers anzugeben.

Bei Aufträgen, die die Aufträge mehrerer Kunden des Börsenteilnehmers zusammenfassen, ist ein Short Code für das Kennzeichen „AGGR“ zu verwenden. Es wird empfohlen, für diesen Fall, als Short Code die „1“ zu verwenden. Aufträge, deren Zuweisung noch aussteht, sind mit einem Short Code für „PNAL“ zu kennzeichnen. Es wird empfohlen, für diesen Fall, als Short Code die „2“ zu verwenden. In beiden Fällen ist eine Angabe der tatsächlichen Client IDs durch den Börsenteilnehmer erst im Rahmen der Transaktionsmeldung an die zuständige nationale Behörde erforderlich.

2.4 Anlageentscheidung innerhalb der Firma

Die Identifikation der Person oder des Computeralgorithmus, der für die Anlageentscheidung in Bezug auf einen Auftrag verantwortlich ist, erfolgt – in Abhängigkeit davon, ob die Person oder der

Computeralgorithmus beim Börsenteilnehmer zu verorten ist oder nicht – aus der Kombination eines Identifikationscodes mit einem speziellen Code zur Qualifizierung des Identifikationscodes (Qualifier) als Mensch (HUMAN) oder als Computeralgorithmus (ALGO). Dieser Qualifier ist in Abhängigkeit der technischen Anbindung an das Handelssystem wie folgt zu übermitteln:

Technische Anbindung über:	Qualifier zu übermitteln als:
T7 GUI	„HUMAN“ oder „ALGO“
ETI oder FIX LF	„22“ für ALGO oder „24“ für HUMAN
Trayport Joule	n/a; wird von gemeldeter Algo-ID abgeleitet
STP (Trade Registration)	„HUMAN“ oder „ALGO“

Als Identifikationscode für einen Mitarbeiter des Börsenteilnehmers ist ein Short Code zu verwenden. Dieser Short Code muss dem Short Code entsprechen, den der Börsenteilnehmer der EEX zuvor für diesen Mitarbeiter mit der entsprechenden NATIONAL_ID mitgeteilt hat. Für einen Computeralgorithmus des Börsenteilnehmers ist als Identifikationscode die Algo-ID zu verwenden, die der Börsenteilnehmer der EEX zuvor für diesen Computeralgorithmus mitgeteilt hat.

Das Feld für den Identifikationscode kann leer gelassen werden, wenn die Anlageentscheidung vom Börsenhändler getroffen wurde, der den Auftrag über seine Nutzerkennung (Trader ID oder User ID) in das Handelssystem eingibt. Die Identifikation erfolgt in diesen Fall über die mit der Nutzerkennung verknüpften NATIONAL_ID des Börsenhändlers, die der EEX im Rahmen der Zulassung des Börsenhändlers mitgeteilt wurde.

Wurde die Anlageentscheidung außerhalb des Börsenteilnehmers, z.B. bei einer Auftragsübermittlung über DEA oder Order Routing Systeme („ORS“) getroffen, sind die Felder für Identifikationscode und Qualifier leer zu lassen. Wurde der Auftrag über DEA oder ORS übermittelt und wurde die Anlageentscheidung durch einen Computeralgorithmus getroffen, ist – in Abweichung zur Bestimmung des vorherigen Satzes – in das Feld für den Identifikationscode die Algo-ID des Computeralgorithmus einzutragen, die der EEX bei Anmeldung des Computeralgorithmus mitgeteilt wurde und der Qualifier „22“ um den Identifikationscode als den eines Computeralgorithmus zu qualifizieren.

Mögliche Szenarien:

Szenarien	Qualifier nach Art der Anbindung	Identifikationscode
Anlageentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist Computeralgorithmus	ALGO	Algo-ID
Anlageentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist von übermittelndem Börsenhändler verschiedene Person	HUMAN	Short Code
Anlageentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist übermittelnder Börsenhändler selbst	HUMAN	[leer] oder Short Code
Anlageentscheidung außerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist entweder Person oder Computeralgorithmus und bei Computeralgorithmus werden Aufträge <u>nicht</u> über DEA/ORS übermittelt	[leer]	[leer]

Szenarien	Qualifier nach Art der Anbindung	Identifikationscode
Anlageentscheidung außerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist Computeralgorithmus und Aufträge werden über DEA/ORS übermittelt	ALGO	Algo-ID

2.5 Ausführung innerhalb der Firma

Die Identifikation der Person oder des Computeralgorithmus, der für die Ausführung des Auftrages verantwortlich ist, erfolgt – in Abhängigkeit davon, ob die Person oder der Computeralgorithmus beim Börsenteilnehmer zu verorten ist oder nicht – aus der Kombination eines Identifikationscodes mit einem speziellen Code zur Qualifizierung des Identifikationscodes (Qualifier) als Mensch (HUMAN) oder als Computeralgorithmus (ALGO). Dieser Qualifier ist in Abhängigkeit der technischen Anbindung an das Handelssystem wie folgt zu übermitteln

Technische Anbindung über:	Qualifier zu übermitteln als:
T7 GUI	n/a; es wird immer „HUMAN“ gespeichert
ETI oder FIX LF	„22“ für ALGO oder „24“ für HUMAN
Trayport Joule	n/a; wird von gemeldeter Algo-ID abgeleitet
STP (Trade Registration)	„HUMAN“ oder „ALGO“

Als Identifikationscode für einen Mitarbeiter des Börsenteilnehmers ist ein Short Code zu verwenden. Dieser Short Code muss dem Short Code entsprechen, den der Börsenteilnehmer der EEX zuvor für diesen Mitarbeiter mit der entsprechenden NATIONAL_ID mitgeteilt hat. Für einen Computeralgorithmus des Börsenteilnehmers ist als Identifikationscode die Algo-ID zu verwenden, die der Börsenteilnehmer der EEX zuvor für diesen Computeralgorithmus mitgeteilt hat.

Das Feld für den Identifikationscode kann leer gelassen werden, wenn für die Ausführung des Auftrages der Börsenhändler des Börsenteilnehmers verantwortlich ist, der den Auftrag über seine Nutzerkennung (Trader ID oder User ID) in das Handelssystem eingibt. Die Identifikation erfolgt in diesem Fall über die mit der Nutzerkennung verknüpften NATIONAL_ID des Börsenhändlers, die der EEX im Rahmen der Zulassung des Börsenhändlers mitgeteilt wurde.

Ist für die Ausführung des Auftrages kein Mitarbeiter und kein Computeralgorithmus beim Börsenteilnehmer verantwortlich und wurden im Fall eines Computeralgorithmus außerhalb des Börsenteilnehmers die Aufträge nicht über DEA oder ORS übermittelt, ist als Identifikationscode der Short Code für das Kennzeichen „NORE“ zusammen mit dem Qualifier für Mensch („24“) zu verwenden. Es wird empfohlen, für das Kennzeichen „NORE“ als Short Code die „3“ zu verwenden.

Wurde die Ausführungsentscheidung außerhalb des Börsenteilnehmers durch einen Computeralgorithmus getroffen und wird der Auftrag über DEA oder ORS übermittelt, ist in das Feld für den Identifikationscode die Algo-ID des Computeralgorithmus einzutragen, die der EEX bei Anmeldung des Computeralgorithmus mitgeteilt wurde und der Qualifier „22“ um den Identifikationscode als den eines Computeralgorithmus zu qualifizieren.

Mögliche Szenarien:

Szenarien	Qualifier nach Art der Anbindung	Identifikationscode
Ausführungsentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist Computeralgorithmus	ALGO	Algo-ID
Ausführungsentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist von übermittelndem Börsenhändler verschiedene Person	HUMAN	Short Code
Ausführungsentscheidung innerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist übermittelnder Börsenhändler	HUMAN	[leer] oder Short code
Ausführungsentscheidung außerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist entweder Person oder Computeralgorithmus, und bei Computeralgorithmus werden Aufträge <u>nicht</u> über DEA/ORS übermittelt	HUMAN	Short Code für „NORE“
Ausführungsentscheidung außerhalb Börsenteilnehmer, verantwortlich ist Computeralgorithmus und Aufträge werden über DEA/ORS übermittelt	ALGO	Algo-ID

2.6 Nicht ausführender Makler

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.7 Handelsbezogene Funktion

Resultiert der Auftragseingang aus dem Handel für eigene Rechnung durch den Börsenteilnehmer, ist die handelsbezogene Funktion mit der für die verwendete technische Anbindung nachstehend vorgegebene Angabe für „DEAL“ zu kennzeichnen sowie ein P- oder M-Positionskonto zu benennen.

In allen anderen Fällen ist die handelsbezogene Funktion mit der für die verwendete technische Anbindung nachstehend vorgegebene Angabe für „AOTC“ zu kennzeichnen sowie ein A- oder G-Positionskonto zu benennen.

Die Angabe über die handelsbezogene Funktion eines Auftrags ist in Abhängigkeit der technischen Anbindung an das Handelssystem wie folgt zu übermitteln:

Technische Anbindung über:	Angabe zu übermitteln als:
T7 GUI	<p>n/a; wird aus gewähltem Konto abgeleitet</p> <ul style="list-style-type: none"> wenn die Kontonummer mit „M“ beginnt, wird die handelsbezogene Funktion auf Market Maker („6“) gesetzt wenn die Kontonummer mit „A“ beginnt, wird die handelsbezogene Funktion auf Agency („1“) gesetzt wenn beides nicht zutrifft, wird die handelsbezogene Funktion auf Proprietary („5“) gesetzt
ETI oder FIX LF	„1“ für Agency (AOTC)

	„5“ für Proprietary (DEAL) „6“ für Market Maker (DEAL)
Trayport Joule	n/a; wird aus gewähltem Konto wie folgt abgeleitet: <ul style="list-style-type: none"> • wenn die Kontonummer mit „M“ beginnt, wird die handelsbezogene Funktion auf Market Maker („6“) gesetzt • wenn die Kontonummer mit „A“ beginnt, wird die handelsbezogene Funktion auf Agency („1“) gesetzt • wenn beides nicht zutrifft, wird die handelsbezogene Funktion auf Proprietary („5“) gesetzt
STP (Trade Registration)	„DEAL“ oder „AOTC“

Die handelsbezogene Funktion „MTCH“ ist an der EEX nicht relevant.

2.8 Liquiditätszufuhr

Wird der Auftrag an die EEX weitergeleitet, um eine Quotierungspflicht oder sonstige Verpflichtung des Börsenteilnehmers, die EEX mit Liquidität zu versorgen, zu erfüllen, ist dieses Feld mit der für die verwendete technische Anbindung nachstehend vorgegebene Angabe für „TRUE“ zu befüllen, ansonsten mit der für die verwendete technische Anbindung nachstehend vorgegebene Angabe für „FALSE“:

Technische Anbindung über:	Angabe zu übermitteln als:
T7 GUI	Durch Anklicken des Feldes „LPrv“ wird TRUE übermittelt; ansonsten FALSE
ETI	„1“ für Liquidity Provision (TRUE) „0“ für No liquidity provision (FALSE)
FIX LF	„2“ für Liquidity Provision Activity Order (TRUE); sonst wird für Auftrag FALSE gespeichert
Trayport Joule	„true“ für Liquidity Provision „false“ für No liquidity provision
STP (Trade Registration)	n/a

2.9 Datum und Uhrzeit

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.10 Gültigkeitsdauer

Für die an der EEX verfügbaren Möglichkeiten der Gültigkeitsdauer eines Auftrags ist dieses Feld in Abhängigkeit von der technischen Anbindung wie folgt zu befüllen:

Technische Anbindung über:	Angabe zu übermitteln als:
T7 GUI	„GFD“ für Good-For-Day; „GTC“ für Good-Till-Cancelled; „IOC“ für Immediate-Or-Cancel; „GTD“ für Good-Till-Date
ETI oder FIX LF	„0“ für Good-For-Day (GFD) „1“ für Good-Till-Cancelled (GTC) „3“ für Immediate-Or-Cancel (IOC) „6“ für Good-Till-Date (GTD)
Trayport Joule	„GoodForDay“ für Good-For-Day; „GoodTillCancelled“ für Good-Till-Cancelled; „ImmediateOrCancel“ für Immediate-Or-Cancel; „GoodTillDate“ für Good-Till-Date
STP (Trade Registration)	n/a

2.11 Auftragsbeschränkung

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.12 Datum und Uhrzeit der Gültigkeitsdauer

Datums- und Zeitformat des Zeitstempels, der in diesem Feld einzugeben ist, richtet sich nach ISO 8601. Die Anzahl der Stellen nach den Sekunden hat den Vorgaben in Abschnitt 2.1.1.3 der Technischen Durchführungsbestimmungen zu entsprechen.

Folgende Daten sind dabei zu verwenden:

Gültigkeitsdauer des Auftrages	Informationen
Good-For-Day	Wird von der EEX befüllt.
Good-Till-Cancelled	Wird von der EEX befüllt.
Good-Till-Date	angegebenes Ablaufdatum mit einem Zeitstempel unmittelbar vor Mitternacht

2.13 Zeitstempel zur Priorisierung von Aufträgen

Dieses Feld ist jeweils zu aktualisieren, wenn sich die Priorität eines Auftrags ändert.

Datums- und Zeitformat des Zeitstempels, der in diesem Feld einzugeben ist, richtet sich nach ISO 8601. Die Anzahl der Stellen nach den Sekunden hat den Vorgaben in Abschnitt 2.1.1.3 der Technischen Durchführungsbestimmungen zu entsprechen.

2.14 Prioritätsvolumen

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.15 Laufende Nummer

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.16 Segment MIC

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.17 Orderbuch-Code

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.18 Identifikationscode des Finanzinstruments

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.19 Eingangsdatum

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.20 Auftragsidentifikationscode

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.21 Ereignisse mit Auswirkungen auf den Auftrag

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.22 Auftragsart

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.23 Klassifizierung der Auftragsart

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.24 Limitpreis

In diesem Feld ist entweder der Höchstpreis, zu dem ein Kaufauftrag ausgeführt werden kann, oder der Mindestpreis, zu dem ein Verkaufsauftrag ausgeführt werden kann, einzutragen.

Für Aufträge ohne Limitpreis oder Aufträge, für die kein Preis festgesetzt ist, ist dieses Feld leer zu lassen.

2.25 Weiterer Limitpreis

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.26 Stop-Preis

Hier ist der Preis einzutragen, der erreicht werden muss, damit der Auftrag aktiv wird.

Falls nicht relevant, ist das Feld leer zu lassen.

2.27 Pegged-Limitpreis

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.28 Transaktionspreis

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.29 Währung des Preises

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.30 Währung von Leg 2

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.31 Preisnotierung

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.32 Kauf/Verkauf-Indikator

In diesem Feld ist anzugeben, ob es sich bei dem Auftrag um einen Kaufauftrag (BUY) oder einen Verkaufsauftrag (SELL) handelt. Der Kauf/Verkauf-Indikator eines Auftrags ist in Abhängigkeit der technischen Anbindung an das Handelssystem wie folgt zu übermitteln:

Technische Anbindung über:	Indikator zu übermitteln als:
T7 GUI	„BUY“ oder „SELL“
ETI oder FIX LF	„1“ für BUY oder „2“ für SELL
Trayport Joule	„Bid“ für BUY oder „Ask“ für SELL
STP (Trade Registration)	wird aus den übermittelten Daten des über Trade Registration abzuschließenden Geschäftes abgeleitet

2.33 Auftragsstatus

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.34 Mengennotierung

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.35 Währung der Menge

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.36 Anfangsmenge

Hier ist die Anzahl der zu kaufenden oder zu verkaufenden Kontrakte anzugeben.

2.37 Restmenge einschließlich nicht sichtbaren Teils

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.38 Angezeigte Menge

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.39 Gehandelte Menge

Dieses Feld wird von der EEX befüllt.

2.40 Minimum Acceptable Quantity (MAQ)

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.41 Minimum Executable Size (MES)

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.42 MES nur erste Ausführung

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.43 Kennzeichen für nur passiv

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.44 Kennzeichen für passiv oder aggressiv

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.45 Self-Execution Prevention

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.46 Identifikationscode für Strategieorder

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.47 Weiterleitungsstrategie

Dieses Feld ist an der EEX nicht relevant und ist daher leer zu lassen.

2.48 Vom Handelsplatz vergebener Transaktionsidentifikationscode

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.49 Handelsphasen

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.50 Indikativer Auktionspreis

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

2.51 Indikatives Auktionsvolumen

Dieses Feld wird von EEX befüllt.

3. Weitere Auftragsdaten

3.1 Risikoindikator bei Warenderivaten

Neben den nach Abschnitt 2 erforderlichen Daten, ist ferner mit jedem Auftrag über Warenderivate mittels des Indikators für Warenderivate („Indikator“) anzugeben, ob mit dem jeweiligen Auftrag ein Geschäft über Warenderivate eingegangen werden soll, mit dem eine objektiv messbare Risikominderung nach Artikel 57 der Richtlinie 2014/65/EU einhergeht (Feld 64 nach Anhang I Tabelle 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590).

Soll mit einem Auftrag ein objektiv messbar risikominderndes Geschäft eingegangen werden, ist der Indikator in Abhängigkeit von der technischen Anbindung wie folgt zu übermitteln:

Technische Anbindung über:	Indikator zu übermitteln als:
T7 GUI	Durch Anklicken des Feldes „CHdg“ wird TRUE übermittelt; ansonsten FALSE
ETI	„1“ für risikomindernd (TRUE) „0“ für nicht risikomindernd (FALSE)
FIX LF	„3“ für Risk Reduction Order (TRUE); sonst wird für Auftrag FALSE gespeichert
Trayport Joule	„true“ für risikomindernd „false“ für nicht risikomindernd
STP (Trade Registration)	„true“ für risikomindernd „false“ für nicht risikomindernd

3.2 MCM-Ausnahme bei EEX Natural Gas Derivaten

Neben den nach Abschnitten 2 und 3.1 erforderlichen Daten, ist nach einer Aktivierung des Marktkorrekturmechanismus nach Artikel 4 der Verordnung (EU) 2022/2578 und Artikel 4 der Verordnung (EU) 2023/736 (MCM) ferner jeder Auftrag über vom MCM erfasste EEX Natural Gas Derivate, der unter eine der Ausnahmen nach Artikel 12 Absatz 4 der Verordnung (EU) 2022/2578 oder Artikel 6 der Verordnung (EU) 2023/736 fällt, wie folgt zu kennzeichnen:

Technische Anbindung über:	Kennzeichnung zu übermitteln als:
T7 GUI	“MCMexemption” in Feld <i>Text1</i>
ETI	“MCMexemption” in Feld <i>25007 / Free Text1</i>
FIX LF	“MCMexemption” in Feld <i>Free Text Field 1</i>
Trayport Joule	“MCMexemption” in Feld <i>Text</i>

Dies gilt nicht für Eingaben zur Registrierung eines Geschäftes oder Aufträge am EEX OTF.