

# Amtsblatt der Europäischen Union

# L 262



Ausgabe  
in deutscher Sprache

Rechtsvorschriften

65. Jahrgang

7. Oktober 2022

## Inhalt

### II Rechtsakte ohne Gesetzescharakter

#### VERORDNUNGEN

- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates bezüglich technischer Regulierungsstandards, in denen die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister und die Art der zu verwendenden Meldungen festgelegt werden <sup>(1)</sup> .....** 1
- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2022/1856 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013 festgelegten technischen Regulierungsstandards durch weitere Präzisierung des Verfahrens für den Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten sowie der technischen und operativen Vereinbarungen für diesen Zugang <sup>(1)</sup> .....** 34
- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2022/1857 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 festgelegten technischen Regulierungsstandards im Hinblick auf die Einzelheiten der Anträge auf Registrierung als Transaktionsregister und Anträge auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister <sup>(1)</sup> .....** 41
- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden <sup>(1)</sup> .....** 46
- ★ **Durchführungsverordnung (EU) 2022/1859 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Änderung der in der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 festgelegten technischen Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format von Anträgen auf Registrierung von Transaktionsregistern und Anträge auf Ausweitung der Registrierung von Transaktionsregistern <sup>(1)</sup> .....** 65

<sup>(1)</sup> Text von Bedeutung für den EWR.

DE

Bei Rechtsakten, deren Titel in magerer Schrift gedruckt sind, handelt es sich um Rechtsakte der laufenden Verwaltung im Bereich der Agrarpolitik, die normalerweise nur eine begrenzte Geltungsdauer haben.

Rechtsakte, deren Titel in fetter Schrift gedruckt sind und denen ein Sternchen vorangestellt ist, sind sonstige Rechtsakte.

- ★ **Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung <sup>(1)</sup> .....** 68

---

<sup>(1)</sup> Text von Bedeutung für den EWR.

## II

(Rechtsakte ohne Gesetzescharakter)

## VERORDNUNGEN

## DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1855 DER KOMMISSION

vom 10. Juni 2022

zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates bezüglich technischer Regulierungsstandards, in denen die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister und die Art der zu verwendenden Meldungen festgelegt werden

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 9 Absatz 5,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 148/2013 vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister bezüglich technischer Regulierungsstandards für die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister wurde erheblich geändert. Da weitere Änderungen erforderlich wären, um den Melderrahmen klarer zu gestalten und die Kohärenz mit neuen technischen Durchführungsstandards und anderen international vereinbarten Standards zu gewährleisten, sollte sie aufgehoben und durch diese Verordnung ersetzt werden.
- (2) Die Meldung vollständiger und genauer Einzelheiten zu den Derivaten, einschließlich der Angabe der Geschäftsereignisse, durch die Änderungen an den Derivaten ausgelöst werden, ist entscheidend dafür, dass die Derivatdaten wirksam genutzt werden können.
- (3) Setzt sich ein Derivatekontrakt aus mehreren Derivatekontrakten zusammen, die zusammen als Ergebnis einer einzigen wirtschaftlichen Vereinbarung ausgehandelt wurden, müssen die zuständigen Behörden die Eigenschaften eines jeden dieser Kontrakte nachvollziehen können. Da die zuständigen Behörden ebenso den Gesamtzusammenhang verstehen müssen, sollte aus der Meldung auch klar hervorgehen, dass der Derivatekontrakt Teil eines komplexen Derivats ist. Daher sollten Derivatekontrakte, die zu einer Kombination aus mehreren Derivatekontrakten gehören, in getrennten Meldungen für jeden Derivatekontrakt gemeldet und mit einer internen Kennung versehen werden, die die Verbindung zwischen den einzelnen Meldungen anzeigt.
- (4) Bei Derivatekontrakten, die sich aus mehreren Derivatekontrakten zusammensetzen und daher mehr als eine Meldung erfordern, lässt sich unter Umständen nur schwer bestimmen, wie die für den einzelnen Kontrakt maßgeblichen Informationen in den einzelnen Meldungen dargelegt und wie viele Meldungen übermittelt werden sollten. Daher sollten sich die Gegenparteien bei den Angaben zu einem solchen Kontrakt über die Anzahl der zu übermittelnden Meldungen verständigen.

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

- (5) Im Interesse der Flexibilität sollten die Gegenparteien die Möglichkeit haben, die Meldung eines Kontrakts der anderen Gegenpartei oder einem Dritten zu übertragen. Die Gegenparteien sollten auch vereinbaren können, die Meldung an eine gemeinsame dritte Stelle, wie eine zentrale Gegenpartei (im Folgenden „CCP“), zu delegieren. Um im Fall, dass eine Meldung im Namen beider Gegenparteien erfolgt, die Datenqualität sicherzustellen, sollte die Meldung alle relevanten Angaben zu jeder Gegenpartei enthalten. Wird die Meldung delegiert, so sollte die Meldung alle Einzelheiten enthalten, die gemeldet worden wären, falls die meldende Gegenpartei die Meldung vorgenommen hätte.
- (6) Es ist wichtig anzuerkennen, dass eine CCP als Partei eines Derivatekontrakts fungiert. Dementsprechend sollte ein bestehender Kontrakt, der anschließend von einer CCP geleast wird, als beendet gemeldet und der neue, sich aus dem Clearing ergebende Kontrakt ebenfalls gemeldet werden.
- (7) Ebenso ist es wichtig anzuerkennen, dass bestimmte Derivate, die beispielsweise an Handelsplätzen oder organisierten Handelsplattformen außerhalb der Union gehandelt werden, durch CCPs geleaste Derivate oder Differenzgeschäfte häufig beendet und in eine Position aufgenommen werden und dass das Risiko solcher Derivate auf Positionsebene gesteuert wird. Ferner ist die daraus resultierende Position, anstelle der ursprünglichen Derivate auf Transaktionsebene, dann Gegenstand der nachfolgenden Lebenszykluseignisse. Um eine effiziente und genaue Meldung solcher Derivate zu ermöglichen, sollte es den Gegenparteien gestattet sein, die Meldung auf Positionsebene vorzunehmen. Um sicherzustellen, dass die Gegenparteien die Meldung auf Positionsebene nicht unangemessen nutzen, sollten spezifische Bedingungen festgelegt werden, die für die Meldung auf Positionsebene erfüllt sein sollten.
- (8) Damit die Konzentration von Risikopositionen und Systemrisiken ordnungsgemäß überwacht werden kann, ist zu gewährleisten, dass den Transaktionsregistern vollständige und genaue Angaben zu den Risiken und den zwischen zwei Gegenparteien ausgetauschten Sicherheiten zur Verfügung gestellt werden. Die Marktpreis- oder Modellpreisbewertung eines Kontrakts gibt Zeichen und Umfang der mit dem Kontrakt verbundenen Risiken an und ergänzt die im Kontrakt gemachten Angaben zum ursprünglichen Wert. Somit kommt es wesentlich darauf an, dass die Gegenparteien Bewertungen von Derivatekontrakten nach einer gemeinsamen Methodik melden. Ebenso wichtig ist es, auch für hinterlegte und entgegengenommene Ersteinschuss- und Nachschussleistungen eine Meldung bezüglich eines bestimmten Derivats vorzuschreiben. Daher sollten Gegenparteien, die ihre Derivate besichern, solche Einzelheiten zur Besicherung auf Transaktionsbasis melden. Werden Sicherheiten auf Portfoliobasis berechnet, sollten die Gegenparteien hinterlegte und erhaltene Ersteinschuss- und Nachschussleistungen für dieses Portfolio unter Verwendung einer von der meldenden Gegenpartei festgelegten einheitlichen Kennziffer melden. Diese einheitliche Kennziffer sollte zur Identifizierung des spezifischen Portfolios dienen, über das die Sicherheit ausgetauscht wird, und sicherstellen, dass alle relevanten Derivate mit dem betreffenden Portfolio verknüpft werden können.
- (9) Der Nennbetrag ist ein wesentliches Merkmal eines Derivats zur Bestimmung der mit diesem Derivat verbundenen Verbindlichkeiten. Darüber hinaus werden Nennbeträge als eine der Messgrößen zur Bewertung der Risikopositionen, des Handelsvolumens und des Umfangs des Derivatemarkts verwendet. Daher ist eine einheitliche Meldung von Nennbeträgen von wesentlicher Bedeutung. Um sicherzustellen, dass die Gegenparteien Nennbeträge auf eine harmonisierte Weise melden, sollte die zur Berechnung des Nennbetrags erforderliche Methode für die verschiedenen Arten von Produkten festgelegt werden.
- (10) Ebenso sollten Informationen über die Bepreisung der Derivate einheitlich gemeldet werden, sodass es den zuständigen Behörden möglich ist, die gemeldeten Risikopositionen zu überprüfen, die Kosten und Liquidität auf den Derivatmärkten zu bewerten und die Preise ähnlicher Produkte, die auf verschiedenen Märkten gehandelt werden, zu vergleichen.
- (11) Infolge von Lebenszykluseignissen wie Clearing, Novation oder Komprimierung werden bestimmte Derivate geschaffen, geändert oder beendet. Damit die zuständigen Behörden die Abfolge von Ereignissen auf dem Markt und die Beziehungen zwischen den gemeldeten Derivaten verstehen können, muss eine Methode zur Verknüpfung aller relevanten Derivate, die von demselben Lebenszykluseignis betroffen sind, bereitgestellt werden. Da die wirksamste Art der Verknüpfung der Derivate von der Art des Ereignisses abhängt, sollten unterschiedliche Verknüpfungsmethoden festgelegt werden.
- (12) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (13) Die ESMA hat zu dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der dieser Verordnung zugrunde liegt, öffentliche Konsultationen durchgeführt, die potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(2)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.

<sup>(2)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

- (14) Damit die Gegenparteien und Transaktionsregister alle erforderlichen Maßnahmen zur Anpassung an die neuen Anforderungen ergreifen können, sollte der Geltungsbeginn dieser Verordnung um 18 Monate verschoben werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

##### **Einzelheiten der Meldungen nach Artikel 9 Absätze 1 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012**

- (1) Die gemäß Artikel 9 Absätze 1 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erfolgenden Meldungen an Transaktionsregister müssen in Bezug auf das betreffende Derivat die vollständigen und genauen Einzelheiten, wie sie in den Tabellen 1, 2 und 3 des Anhangs der vorliegenden Verordnung festgelegt sind, enthalten.

Diese Einzelheiten sind in einer einzigen Meldung zu übermitteln.

- (2) Bei der Meldung des Abschlusses, der Änderung oder der Beendigung des Derivats gibt eine Gegenpartei in ihrer Meldung — wie in den Feldern 151 und 152 der Tabelle 2 des Anhangs beschrieben — die Einzelheiten der Art der Maßnahme und des Ereignisses an, auf die sich der Abschluss, die Änderung oder die Beendigung bezieht.

- (3) Wenn eine wirksame Meldung der in Absatz 1 genannten Einzelheiten anhand der Felder in den Tabellen 1, 2 und 3 des Anhangs nicht möglich ist, so sind diese Einzelheiten — abweichend von Absatz 1 — in getrennten Meldungen zu übermitteln, wie beispielsweise auch dann, wenn sich der Derivatekontrakt aus mehreren Derivatekontrakten zusammensetzt, die gemeinsam als Produkt einer einzigen wirtschaftlichen Vereinbarung ausgehandelt werden.

Die Gegenparteien eines Derivatekontrakts, der sich aus mehreren Derivatekontrakten im Sinne des Unterabsatzes 1 zusammensetzt, einigen sich vor Ablauf der Meldefrist auf die Anzahl der für diesen Derivatekontrakt an ein Transaktionsregister zu übermittelnden getrennten Meldungen.

Die meldende Gegenpartei verknüpft die getrennten Meldungen durch eine Kennung, die gemäß dem Feld 6 der Tabelle 2 des Anhangs bei der Gegenpartei ausschließlich für die betreffende Gruppe von Derivatemeldungen verwendet wird.

- (4) Erfolgt eine Meldung im Namen beider Gegenparteien, so enthält diese die in den Tabellen 1, 2 und 3 des Anhangs geforderten Einzelheiten zu jeder Gegenpartei.

- (5) Meldet eine Gegenpartei die Einzelheiten eines Derivats im Namen der anderen Gegenpartei an ein Transaktionsregister oder meldet ein Dritter einen Kontrakt im Namen einer oder beider Gegenparteien an ein Transaktionsregister, so sind sämtliche Einzelheiten anzugeben, die bei einer getrennten Meldung der Derivate an das Transaktionsregister durch die Gegenparteien mitgeteilt worden wären.

#### Artikel 2

##### **Geclearte Geschäfte**

- (1) Wird ein Derivat, dessen Einzelheiten bereits gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 gemeldet worden sind, anschließend durch eine zentrale Gegenpartei (im Folgenden „CCP“) gecleart, wird dieses Derivat als beendet gemeldet und zu diesem Zweck in den Feldern 151 und 152 der Tabelle 2 des Anhangs „Beendigung“ als Art des Vorgangs und „Clearing“ als Ereignisart angegeben. Neue Derivate, die sich aus dem Clearing ergeben, werden gemeldet, indem in den Feldern 151 und 152 der Tabelle 2 des Anhangs dieser Verordnung „Neu“ als Art des Vorgangs und „Clearing“ als Ereignisart angegeben wird.

- (2) Wird ein Derivat an einem Handelsplatz bzw. auf einer organisierten Handelsplattform außerhalb der Union abgeschlossen und zugleich von einer CCP am selben Tag gecleart, sind lediglich die sich aus dem Clearing ergebenden Derivate zu melden. Diese Derivate werden gemeldet, indem in den Feldern 151 und 152 der Tabelle 2 des Anhangs entweder „Neu“ oder „Positionskomponente“ als Art des Vorgangs gemäß Artikel 3 Absatz 2 und „Clearing“ als Ereignisart angegeben werden.

### Artikel 3

#### Meldung auf Positionsebene

(1) Nach der Meldung der Einzelheiten eines Derivats, das eine Gegenpartei geschlossen hat, und der Beendigung dieses Derivats aufgrund der Aufnahme in eine Position ist es einer Gegenpartei gestattet, die Meldung auf Positionsebene zu verwenden, sofern alle folgenden Bedingungen erfüllt sind:

- a) das Risiko wird auf Positionsebene gesteuert,
- b) die Meldungen beziehen sich auf Derivate, die an einem Handelsplatz bzw. auf einer organisierten Handelsplattform außerhalb der Union abgeschlossen wurden, auf Derivate, die von einer CCP gecleart wurden, oder auf fungible Differenzgeschäfte, die durch die Position ersetzt wurden,
- c) die in Feld 154 der Tabelle 2 des Anhangs genannten Derivate auf Transaktionsebene wurden vor ihrer Aufnahme in die Position korrekt gemeldet,
- d) sonstige Ereignisse, die die gemeinsamen Felder in der Meldung über die Position betreffen, werden getrennt gemeldet,
- e) die unter Buchstabe b genannten Derivate wurden ordnungsgemäß beendet, indem in Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs „Beendigung“ als Art des Vorgangs und in Feld 152 der Tabelle 2 des Anhangs „Aufnahme in eine Position“ als Ereignisart angegeben wurde,
- f) die daraus resultierende Position wurde entweder als neue Position oder als Aktualisierung einer bestehenden Position ordnungsgemäß gemeldet,
- g) die Meldung der Position ist korrekt erfolgt, indem alle einschlägigen Felder der Tabellen 1 und 2 des Anhangs ausgefüllt wurden und darauf hingewiesen wurde, dass die Meldung auf Positionsebene in Feld 154 der Tabelle 2 des Anhangs erfolgt,
- h) die Gegenparteien des Derivats kommen darin überein, dass das Derivat auf Positionsebene gemeldet werden sollte.

(2) Wenn ein bestehendes Derivat am selben Tag in eine Meldung auf Positionsebene aufgenommen werden soll, so ist dieses Derivat mit dem Eintrag „Positionskomponente“ als Art des Vorgangs in Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs zu melden.

(3) Die nachfolgenden Aktualisierungen, einschließlich Aktualisierungen der Bewertung, Aktualisierungen von Sicherheiten und sonstige Änderungen und Lebenszyklusereignisse, werden auf Positionsebene gemeldet; sie werden nicht für die ursprünglichen Derivate auf Transaktionsebene gemeldet, die beendet und in diese Position aufgenommen wurden.

### Artikel 4

#### Meldung von Risiken

(1) Die Daten zur Besicherung für geclearte wie auch für nicht geclearte Derivate umfassen alle hinterlegten und empfangenen Sicherheiten, wie sie in den Feldern 1 bis 29 der Tabelle 3 des Anhangs aufgeführt sind.

(2) Wenn eine Gegenpartei 1 auf Portfoliobasis besichert ist, meldet die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung zuständige Stelle einem Transaktionsregister die auf Portfoliobasis hinterlegten und empfangenen Sicherheiten gemäß der Felder 1 bis 29 der Tabelle 3 des Anhangs und gibt eine Kennziffer zur Identifizierung des Portfolios gemäß dem Feld 9 der Tabelle 3 des Anhangs an.

(3) Andere als die in Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten nichtfinanziellen Gegenparteien oder die für die Meldung in ihrem Namen verantwortlichen Stellen sind nicht zur Meldung von Sicherheiten und der Bewertung zu Markt- oder zu Modellpreisen der Kontrakte gemäß Tabelle 2 und 3 des Anhangs der vorliegenden Verordnung verpflichtet.

(4) Bei Derivaten, die von einer CCP gecleart wurden, übermittelt die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung verantwortliche Stelle die von der CCP in den Feldern 21 bis 25 der Tabelle 2 des Anhangs vorgenommene Bewertung des Derivats.

(5) Bei Derivaten, die nicht von einer CCP gecleart wurden, übermittelt die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung verantwortliche Stelle die in den Feldern 21 bis 25 der Tabelle 2 des Anhangs vorgenommene Bewertung des Derivats, bei der nach der in den internationalen Rechnungslegungsstandards (IFRS) 13 Bemessung des beizulegenden Zeitwerts definierten und durch die Verordnung (EG) Nr. 1126/2008 der Kommission <sup>(3)</sup> übernommenen Methode zu verfahren ist.

<sup>(3)</sup> Verordnung (EG) Nr. 1126/2008 der Kommission vom 3. November 2008 zur Übernahme bestimmter internationaler Rechnungslegungsstandards gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1606/2002 des Europäischen Parlaments und des Rates (Text von Bedeutung für den EWR) (ABl. L 320 vom 29.11.2008, S. 1).

*Artikel 5***Nennbetrag**

- (1) Der in den Feldern 55 und 64 der Tabelle 2 des Anhangs genannte Nennbetrag des Derivates ist:
- a) bei in Geldeinheiten gehandelten Swaps, börsengehandelten Finanzterminkontrakten, außerbörslichen Finanzterminkontrakten und Optionen der Referenzbetrag,
  - b) bei anderen als den unter Buchstabe a genannten Optionen der Basispreis,
  - c) bei anderen als den unter Buchstabe a genannten außerbörslichen Finanzterminkontrakten das Produkt aus dem Terminkurs und der gesamten Nennmenge des Basiswerts,
  - d) bei Aktien-Dividenden-Swaps das Produkt aus dem für den Zeitraum festgelegten Basispreis und der Anzahl der Aktien oder Indexeinheiten,
  - e) bei Aktien-Volatilitäts-Swaps der Vega-Nennbetrag,
  - f) bei Aktien-Varianz-Swaps den Varianzbetrag,
  - g) bei finanziellen Differenzgeschäften der sich aus dem Anfangspreis und der gesamten Nennmenge ergebende Betrag,
  - h) bei Fix/Float-Swaps im Zusammenhang mit Waren/Rohstoffen das Produkt aus dem Festpreis und der gesamten Nennmenge,
  - i) bei Waren-/Rohstoff-Basiswaps das Produkt aus dem letzten zum Zeitpunkt der Transaktion verfügbaren Kassakurs des Basiswerts des „Legs“ ohne Spread und der gesamten Nennmenge des „Legs“ ohne Spread,
  - j) bei Swaptions der Nennbetrag des Basiskontrakts,
  - k) bei nicht unter den Buchstaben a) bis j) genannten Derivaten, bei denen der Nennbetrag anhand des Preises des Basiswerts berechnet wird und dieser Preis nur zum Zeitpunkt der Abrechnung verfügbar ist, der Tagesschlusspreis des Basiswerts zum Zeitpunkt des Abschlusses des Kontrakts.
- (2) Bei der erstmaligen Meldung eines Derivatekontrakts, dessen Nennbetrag sich im Laufe der Zeit verändert, sind der Nennbetrag zum Zeitpunkt des Abschlusses des Derivatekontrakts und der Zeitplan für den Nennbetrag anzugeben.

Bei der Meldung des Zeitplans für den Nennbetrag geben die Gegenparteien alle folgenden Informationen an:

- i) den nicht aktualisierten Zeitpunkt, zu dem der zugehörige Nennbetrag wirksam wird,
- ii) den nicht aktualisierten Endtermin des Nennbetrags,
- iii) den Nennbetrag, der am zugehörigen nicht aktualisierten Tag des Wirksamwerdens wirksam wird.

*Artikel 6***Preis**

- (1) Der in Feld 48 der Tabelle 2 des Anhangs genannte Preis eines Derivats ist:
- a) bei Swaps mit periodischen Zahlungen in Bezug auf Rohstoffe der Festpreis,
  - b) bei außerbörslichen Finanzterminkontrakten, die sich auf Waren/Rohstoffe und Aktien beziehen, der Terminkurs des Basiswerts,
  - c) bei Swaps, die sich auf Aktien und Differenzgeschäfte beziehen, der Ausgangspreis des Basiswerts.

(2) Der Preis eines Derivats ist in Feld 48 der Tabelle 2 des Anhangs nicht anzugeben, wenn er in einem anderen Feld der Tabelle 2 des Anhangs angegeben wurde.

#### Artikel 7

##### **Verknüpfung der Meldungen**

Die meldende Gegenpartei oder die für die Meldung verantwortliche Stelle verknüpft die Meldungen zu Derivaten, die infolge des in Feld 152 in Tabelle 2 des Anhangs genannten Ereignisses abgeschlossen oder beendet wurden, wie folgt:

- a) bei Clearing, Step-in, Zuordnung und Ausübung meldet die Gegenpartei die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer („UTI“) des ursprünglichen Derivats, das infolge des in Feld 152 in Tabelle 2 des Anhangs genannten Ereignisses beendet wurde, in Feld 3 der Tabelle 2 des Anhangs im Rahmen der Meldung oder den Meldungen zu dem Derivat oder den Derivaten, die aus diesem Ereignis resultiert sind,
- b) bei der Aufnahme eines Derivats in eine Position meldet die Gegenpartei die UTI der Position, in die dieses Derivat gemäß Feld 4 in Tabelle 2 des Anhangs aufgenommen wurde, im Rahmen der Meldung dieses Derivats, die mit „Positionskomponente“ als Art des Vorgangs oder einer Kombination aus „Beendigung“ als Art des Vorgangs und „Aufnahme in eine Position“ als Ereignisart übermittelt wurde.
- c) bei einem Ereignis zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (im Folgenden „PTRR“) bei einem PTRR-Dienstleister oder einer CCP, die den PTRR-Dienst erbringt, meldet die Gegenpartei in allen Meldungen zu den Derivaten, die entweder aufgrund dieses Ereignisses beendet wurden oder daraus resultieren, in Feld 5 in Tabelle 2 des Anhangs eine einheitliche Kennziffer zur Identifizierung dieses Ereignisses.

#### Artikel 8

##### **Aufhebung**

Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 148/2013 wird aufgehoben.

Bezugnahmen auf die aufgehobene Verordnung gelten als Bezugnahmen auf die vorliegende Verordnung.

#### Artikel 9

##### **Inkrafttreten**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 29. April 2024.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN



## ANHANG

Tabelle 1

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit der Übermittlung der Meldung an das Transaktionsregister.
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	Hat die für die Meldung zuständige Stelle die Übermittlung der Meldung an einen Dritten oder die andere Gegenpartei delegiert, so wird die betreffende Stelle in diesem Feld mittels einer einheitlichen Kennziffer angegeben. Andernfalls sollte in diesem Feld die für die Meldung zuständige Stelle angegeben werden.
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	Wenn eine finanzielle Gegenpartei gemäß Artikel 9 Absatz 1a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(1)</sup> allein die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen beider Gegenparteien trägt und die nichtfinanzielle Gegenpartei beschließt, die Einzelheiten ihrer mit der finanziellen Gegenpartei geschlossenen OTC-Derivatekontrakte nicht selbst zu melden, so ist die einheitlichen Kennziffer zur Identifizierung dieser finanziellen Gegenpartei anzugeben. Trägt eine Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 9 Absatz 1b der genannten Verordnung die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (im Folgenden „OGAW“), so ist die einheitliche Kennziffer der Verwaltungsgesellschaft anzugeben. Trägt ein Verwalter alternativer Investmentfonds (im Folgenden „AIFM“) gemäß Artikel 9 Absatz 1c der genannten Verordnung die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen eines alternativen Investmentfonds, so ist die einheitliche Kennziffer des AIFM anzugeben. Trägt eine zugelassene Stelle, die für die Verwaltung einer EbAV verantwortlich ist und in ihrem Namen handelt, die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung in ihrem Namen gemäß Artikel 9 Absatz 1d der genannten Verordnung, so ist die einheitliche Kennziffer dieser Stelle anzugeben. Dieses Feld gilt nur für OTC-Derivate.
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (Meldende Gegenpartei)	Kennung der Gegenpartei eines Derivategeschäfts, die ihre Meldepflicht über die betreffende Meldung erfüllt. Im Falle eines zugeordneten Derivategeschäfts, das von einem Fondsmanager im Namen eines Fonds durchgeführt wird, wird der Fonds und nicht der Fondsmanager als Gegenpartei gemeldet.
5	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 1	Geben Sie an, ob es sich bei Gegenpartei 1 um eine zentrale Gegenpartei (im Folgenden „CCP“), eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 2 Nummern 1, 8 und 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 oder um eine Einrichtung im Sinne des Artikels 1 Absatz 5 der genannten Verordnung handelt.
6	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 1	Art der Unternehmenstätigkeiten der Gegenpartei 1. Handelt es sich bei der Gegenpartei 1 um eine finanzielle Gegenpartei, so sind in diesem Feld alle in der Taxonomie für finanzielle Gegenparteien in Feld 6 der Tabelle 1 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission <sup>(2)</sup> erforderlichen Kennziffern anzugeben, die für diese Gegenpartei gelten.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			<p>Handelt es sich bei der Gegenpartei 1 um eine nichtfinanzielle Gegenpartei, so sind in diesem Feld alle in der Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien in Feld 6 der Tabelle 1 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 erforderlichen Kennziffern anzugeben, die für diese Gegenpartei gelten.</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, so sind die Kennziffern in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der jeweiligen Tätigkeit einzufügen.</p>
7	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 1	Angabe, ob die Gegenpartei 1 zum Zeitpunkt des Abschlusses der Transaktion über der in Artikel 4a Absatz 3 oder Artikel 10 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Clearingschwelle liegt.
8	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	Angabe, ob die LEI zur Identifizierung der Gegenpartei 2 verwendet wurde.
9	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	Kennung der zweiten Gegenpartei eines Derivategeschäfts. Im Falle eines zugeordneten Derivategeschäfts, das von einem Fondsmanager im Namen eines Fonds durchgeführt wird, wird der Fonds und nicht der Fondsmanager als Gegenpartei gemeldet.
10	Parteien des Derivats	Land der Gegenpartei 2	Falls es sich bei der Gegenpartei 2 um eine natürliche Person handelt, ist der Code des Landes des Wohnsitzes dieser Person anzugeben.
11	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 2	Geben Sie an, ob es sich bei der Gegenpartei 2 um eine CCP, eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 2 Nummern 1, 8 und 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 oder um eine Stelle im Sinne des Artikels 1 Nummer 5 der genannten Verordnung handelt.
12	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 2	<p>Art der Unternehmenstätigkeiten der Gegenpartei 2.</p> <p>Handelt es sich bei der Gegenpartei 2 um eine finanzielle Gegenpartei, so sind in diesem Feld alle in der Taxonomie für finanzielle Gegenparteien in Feld 6 der Tabelle 1 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 erforderlichen Kennziffern anzugeben, die für diese Gegenpartei gelten.</p> <p>Handelt es sich bei der Gegenpartei 2 um eine nichtfinanzielle Gegenpartei, so sind in diesem Feld alle in der Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien in Feld 6 der Tabelle 1 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 erforderlichen Kennziffern anzugeben, die für diese Gegenpartei gelten.</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, so sind die Kennziffern in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der jeweiligen Tätigkeit einzufügen.</p>
13	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 2	Angabe, ob die Gegenpartei 2 zum Zeitpunkt des Abschlusses der Transaktion über der in Artikel 4a Absatz 3 oder Artikel 10 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Clearingschwelle liegt.
14	Parteien des Derivats	Meldepflicht der Gegenpartei 2	Angabe, ob der Gegenpartei 2 die Meldepflicht gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 obliegt, unabhängig davon, wer für ihre Meldung die Verantwortung und die gesetzliche Haftung trägt.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
15	Parteien des Derivats	Makler-ID	Agiert ein Makler als Intermediär der Gegenpartei 1 ohne selbst Gegenpartei zu werden, so gibt die Gegenpartei 1 die Identität dieses Maklers mittels einer einheitlichen Kennziffer an.
16	Parteien des Derivats	Clearingmitglied	Kennung des Clearingmitglieds, über das ein Derivategeschäft über eine CCP gecleart wurde. Dieses Datenelement gilt für geclearte Transaktionen.
17	Parteien des Derivats	Richtung	Angabe, ob die Gegenpartei 1 der Käufer oder der Verkäufer ist, wie am Tag des Abschlusses des Derivats festgelegt.
18	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 1	Angabe, ob die Gegenpartei 1 der Zahler oder der Empfänger von Leg 1 ist, wie am Tag des Abschlusses des Derivats festgelegt.
19	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 2	Angabe, ob die Gegenpartei 1 der Zahler oder der Empfänger von Leg 2 ist, wie am Tag des Abschlusses des Derivats festgelegt.
20	Parteien des Derivats	Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement	Angabe, ob der Kontrakt objektiv im Sinne des Artikels 10 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 direkt messbar mit der Geschäftstätigkeit oder dem Liquiditäts- und Finanzmanagement der Gegenpartei 1 verbunden ist. Dieses Feld ist nur auszufüllen, wenn die Gegenpartei 1 eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 2 Nummer 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ist.

(<sup>1</sup>) Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

(<sup>2</sup>) Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung (siehe Seite 68 dieses Amtsblatts).

Tabelle 2

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
1	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI	Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer gemäß Artikel 7 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.
2	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Laufende Meldenummer	Wenn ein Derivat an einem Handelsplatz ausgeführt wurde, eine vom Handelsplatz generierte Nummer, die nur für diese Ausführung gilt.
3	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Vorherige UTI (für „one-to-one“- und „one-to-many“-Beziehungen zwischen Transaktionen)	UTI der Vorgängertransaktion, die aufgrund eines Lebenszyklusereignisses zu der gemeldeten Transaktion geführt hat, und zwar in einer „one-to-one“-Beziehung zwischen Transaktionen (z. B. im Falle einer Novation, wenn eine Transaktion beendet und eine neue Transaktion generiert wird) oder in einer „one-to-many“-Beziehung zwischen Transaktionen (z. B. beim Clearing oder wenn eine Transaktion in mehrere verschiedene Transaktionen aufgeteilt wird). Dieses Datenelement ist nicht anwendbar, wenn „many-to-one“- und „many-to-many“-Beziehungen zwischen Transaktionen gemeldet werden (z. B. im Falle einer Reduktion (Compression)).

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
4	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI der späteren Position	Die UTI der Position, in der ein Derivat enthalten ist. Dieses Feld gilt nur für Meldungen im Zusammenhang mit der Beendigung eines Derivats aufgrund seiner Aufnahme in eine Position.
5	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	ID des Dienstes zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (PTRR)	Kennung, die von dem PTRR-Dienstleister oder der den PTRR-Dienst erbringenden CCP generiert wird, um alle Derivate, die in ein bestimmtes PTRR-Ereignis eingehen und aus diesem PTRR-Ereignis resultieren, miteinander zu verbinden.
6	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Kennung des Pakets	Kennung (bestimmt von der Gegenpartei 1) zur Verknüpfung von Derivaten im selben Paket gemäß Artikel 1 Absatz 3 Unterabsatz 3 dieser Verordnung. Ein Paket kann meldepflichtige und nicht meldepflichtige Transaktionen umfassen.
7	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Internationale Wertpapier- Identifikationsnummer (ISIN)	ISIN zur Identifizierung des Produkts, wenn dieses Produkt zum Handel zugelassen oder auf einem geregelten Markt, MTF, OTF oder systematischen Internalisierer gehandelt wird.
8	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Eindeutige Produktkennung (UPI)	UPI zur Identifizierung des Produkts.
9	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Produktklassifizierung	Die sich auf das Instrument beziehende Kennziffer zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten (CFI).
10	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art des Kontrakts	Klassifizierung des gemeldeten Kontrakts nach Kontrakttyp.
11	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kategorie von Vermögenswerten	Klassifizierung des gemeldeten Kontrakts nach der zugrunde gelegten Kategorie von Vermögenswerten.
12	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Derivat auf Basis von Kryptoanlagen	Angabe, ob das Derivat auf Kryptoanlagen basiert.
13	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art der Identifizierung der Basiswerte	Art der entsprechenden Kennung des Basiswerts.
14	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Identifizierung der Basiswerte	Der direkte Basiswert wird anhand einer einheitlichen Kennung auf der Grundlage der Art des Basiswerts identifiziert. Bei Credit Default Swaps sollte die ISIN der Referenzverbindlichkeit angegeben werden.
15	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Indikator des Basisindexes	Angabe des Basisindexes, sofern verfügbar.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
16	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Name des Basisindexes	Vollständiger Name des vom Indexanbieter zugewiesenen Basisindexes.
17	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Code des kundenspezifischen Korbs	Beruhet das Derivategeschäft auf einem kundenspezifischen Korb, ist die einheitliche Kennziffer anzugeben, der vom Strukturierer des kundenspezifischen Korbs für die Verknüpfung der Bestandteile zugewiesen wurde.
18	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kennung der Bestandteile des Korbs	Bei kundenspezifischen Körben, die sich u. a. aus Finanzinstrumenten zusammensetzen, die an einem Handelsplatz gehandelt werden, sind lediglich die an einem Handelsplatz gehandelten Finanzinstrumente anzugeben.
19	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung 1	Währung für die Barzahlung der Transaktion, falls zutreffend. Bei Produkten in mehreren Währungen, die nicht netto saldieren, ist die Abwicklungswährung von Leg 1 anzugeben. Dieses Datenelement gilt nicht für physisch abgewickelte Produkte (z. B. physisch abgewickelte Swaptions).
20	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung 2	Währung für die Barzahlung der Transaktion, falls zutreffend. Bei Produkten in mehreren Währungen, die nicht netto saldieren, ist die Abwicklungswährung von Leg 2 anzugeben. Dieses Datenelement gilt nicht für physisch abgewickelte Produkte (z. B. physisch abgewickelte Swaptions).
21	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsbetrag	Bewertung des Kontrakts zu Markt- oder zu Modellpreisen gemäß Artikel 4 dieser Verordnung. Bewertung der CCP, die für ein gecleartes Geschäft heranzuziehen ist.
22	Abschnitt 2c – Bewertung	Währung der Bewertung	Währung des Bewertungsbetrags.
23	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungszeitstempel	Datum und Uhrzeit der letzten Bewertung zu Marktpreisen, die von der CCP bereitgestellt oder anhand des aktuellen oder letzten verfügbaren Marktpreises der Inputs berechnet wurde.
24	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsmethode	Für die Bewertung des Geschäfts durch die Gegenpartei 1 verwendete Quelle und Methode. Wird mindestens ein Bewertungsinput verwendet, der als Bewertung zu Modellpreisen eingestuft ist, wird die gesamte Bewertung als Bewertung zu Modellpreisen eingestuft. Werden nur Inputs verwendet, die als Bewertung zu Marktpreisen eingestuft werden, wird die gesamte Bewertung als Bewertung zu Marktpreisen eingestuft.
25	Abschnitt 2c – Bewertung	Delta	Das Verhältnis zwischen der Preisänderung eines Derivategeschäfts und der Preisänderung des Basiswerts. Dieses Feld gilt nur für Optionen und Swaptions. Eine Delta-Aktualisierung wird von finanziellen Gegenparteien und nichtfinanziellen Gegenparteien gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 täglich gemeldet.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
26	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	Angabe, ob die Sicherung auf Portfoliobasis hinterlegt wurde. Unter „auf Portfoliobasis“ ist eine Reihe von Transaktionen zu verstehen, die zusammen (entweder auf Netto- oder auf Bruttobasis) verknüpft werden, im Gegensatz zu dem Szenario, in dem die Einschuss-/Nachschusszahlung für jede einzelne Transaktion separat berechnet und gebucht wird.
27	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	Wenn Sicherheiten auf Portfoliobasis gemeldet werden, ist die einheitliche Kennziffer, die die Gegenpartei 1 dem Portfolio zuweist, anzugeben. Dieses Datenelement gilt nicht für Fälle, wenn die Besicherung auf Transaktionsebene erfolgt ist, wenn keine Besicherungsvereinbarung besteht oder wenn keine Sicherheit hinterlegt oder entgegengenommen wurde.
28	Abschnitt 2e – Risikominderung/Meldung	Bestätigungszeitstempel	Datum und Uhrzeit der Bestätigung gemäß Artikel 12 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 149/2013 der Kommission <sup>(1)</sup> . Gilt nur für nicht durch eine CCP geclearte OTC-Derivatekontrakte.
29	Abschnitt 2e – Risikominderung/Meldung	Bestätigt	Bei neuen meldepflichtigen Geschäften die Angabe, ob die verbindlichen Bedingungen eines OTC-Derivatekontrakts dokumentiert und vereinbart (bestätigt) wurden oder nicht (unbestätigt). Falls sie dokumentiert und vereinbart wurden, ist anzugeben, ob eine solche Bestätigung erfolgt ist: — über eine gemeinsame Bestätigungseinrichtung oder -plattform oder über ein privates oder bilaterales elektronisches System (elektronisch), — über ein von Menschen lesbares schriftliches Dokument wie Fax, Papier oder manuell bearbeitete E-Mails (nicht-elektronisch). Gilt nur für nicht durch eine CCP geclearte OTC-Derivatekontrakte.
30	Abschnitt 2f – Clearing	Clearingpflicht	Angabe, ob der gemeldete Kontrakt einer Kategorie von OTC-Derivaten angehört, die der Clearingpflicht unterliegt, und ob beide Gegenparteien des Kontrakts zum Zeitpunkt der Ausführung des Kontrakts der Clearingpflicht gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 unterliegen. Gilt nur für OTC-Derivatekontrakte.
31	Abschnitt 2f – Clearing	Gecleart	Angabe, ob das Derivat durch eine CCP gecleart wurde.
32	Abschnitt 2f – Clearing	Clearing-Zeitstempel	Uhrzeit und Datum des Clearings. Gilt nur für durch eine CCP geclearte Derivatekontrakte.
33	Abschnitt 2f – Clearing	Zentrale Gegenpartei	Kenntung der CCP, die das Geschäft gecleart hat. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn der Wert des Datenelements „Cleared“ „N“ („Nein, nicht zentral gecleart“) lautet.
34	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art des Rahmenvertrags	Verweis auf die Art des Rahmenvertrags, unter dem die Gegenparteien ein Derivat abgeschlossen haben.
35	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Andere Art der Rahmenvertrags	Bezeichnung des Rahmenvertrags. Dieses Feld ist nur auszufüllen, wenn in Feld 34 dieser Tabelle „OTHR“ angegeben wurde.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
36	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Fassung des Rahmenvertrags	Gegebenenfalls Angabe des Jahres des für das gemeldete Geschäft relevanten Rahmenvertrags.
37	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gruppenintern	Gibt an, ob der Kontrakt als gruppeninternes Geschäft im Sinne des Artikels 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 geschlossen wurde.
38	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR	Angabe, ob der Vertrag aus einem PTRR-Vorgang resultiert.
39	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art des PTRR-Verfahrens	<p>Indikator der Art eines PTRR-Vorgangs für die Zwecke der Meldung gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012.</p> <p>Portfoliokomprimierung ohne Drittdienstleister: Eine Vereinbarung zur Verringerung des Risikos in bestehenden Transaktionsportfolios, unter Verwendung von nicht kursbildenden Geschäften, hauptsächlich zur Verringerung des ausstehenden Nennbetrags, der Anzahl der Geschäfte oder zur anderweitigen Harmonisierung der Bedingungen, indem die Geschäfte ganz oder teilweise beendet werden und die beendeten Derivate in der Regel durch neue Ersatzgeschäfte ersetzt werden.</p> <p>Portfoliokomprimierung mit einem Drittdienstleister oder einer CCP: Eine PTRR-Dienstleistung, die von einem Dienstleister oder einer CCP erbracht wird, um Risiken in bestehenden Transaktionsportfolios zu verringern, unter Verwendung von nicht kursbildenden Geschäften, hauptsächlich zur Verringerung des ausstehenden Nennbetrags, der Anzahl der Geschäfte oder zur anderweitigen Harmonisierung der Bedingungen, indem die Geschäfte ganz oder teilweise beendet werden und die beendeten Derivate in der Regel durch neue Ersatzgeschäfte ersetzt werden.</p> <p>Portfolio Wiederausgleich/Margin-Management: Eine PTRR-Dienstleistung, die von einem Dienstleister erbracht wird, um Risiken in einem bestehenden Transaktionsportfolio zu verringern, indem neue nicht kursbildende Geschäfte hinzugefügt werden und wenn keine bestehenden Geschäfte im Portfolio beendet oder ersetzt werden und der Nominalwert eher erhöht als verringert wird.</p> <p>Sonstige PTRR-Dienstleistungen im Rahmen des Portfolios: Eine PTRR-Dienstleistung, die von einem Dienstleister erbracht wird, um Risiken in bestehenden Transaktionsportfolios durch Verwendung von nicht kursbildenden Geschäften zu verringern, und sofern eine solche Dienstleistung nicht als Portfoliokomprimierung oder Portfolio-Rebalancing gilt.</p>
40	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR-Dienstleister	LEI des PTRR-Dienstleisters.
41	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Ausführungsplatz	<p>Die Identifikation des Handelsplatzes, an dem das Geschäft getätigt wurde.</p> <p>Für Geschäfte, die an einem Handelsplatz, über einen systematischen Internalisierer (im Folgenden „SI“) oder eine organisierte Handelsplattform außerhalb der Union ausgeführt wurden, ist der Segment-MIC nach ISO 10383 zu verwenden. Ist kein Segment-MIC verfügbar, ist der Operating-MIC zu verwenden.</p> <p>Der MIC-Code „XOFF“ ist für Finanzinstrumente zu verwenden, die zum Handel zugelassen sind oder an einem Handelsplatz gehandelt werden oder für die ein Antrag auf Zulassung gestellt wurde, wenn das Geschäft mit diesem Finanzinstrument nicht an einem Handelsplatz, über einen SI oder eine organisierten Handelsplattform außerhalb der Union ausgeführt wird oder wenn eine Gegenpartei nicht weiß, dass sie mit einer Gegenpartei 2 handelt, die als SI fungiert.</p>

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			Der MIC-Code „XXXX“ ist für Finanzinstrumente zu verwenden, die nicht zum Handel zugelassen sind oder an einem Handelsplatz gehandelt werden oder für die kein Antrag auf Zulassung gestellt wurde und die nicht auf einer organisierten Handelsplattform außerhalb der Union gehandelt werden.
42	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ausführungszeitstempel	Datum und Uhrzeit der ursprünglichen Ausführung einer Transaktion, die zur Generierung einer neuen UTI führte. Dieses Datenelement bleibt während der gesamten Lebensdauer der UTI unverändert. Für Meldungen auf Positionsebene ist der Zeitpunkt anzugeben, zu dem die Position zum ersten Mal geöffnet wurde.
43	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem die in der Bestätigung enthaltenen Verpflichtungen aus dem OTC-Derivategeschäft gelten. Wenn der Geltungsbeginn nicht als Teil der Bedingungen des Kontrakts festgelegt ist, melden die Gegenparteien in diesem Feld das Datum der Ausführung des Derivats.
44	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ablaufdatum	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem die in der Bestätigung enthaltenen Verpflichtungen aus dem Derivategeschäft nicht mehr gelten. Eine vorzeitige Beendigung hat keinen Einfluss auf dieses Datenelement.
45	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Datum der vorzeitigen Beendigung	Geltungsdatum der vorzeitigen Beendigung (Ablauf) des gemeldeten Geschäfts. Dieses Datenelement gilt, wenn das Geschäft aufgrund einer Ex-Interim-Entscheidung einer oder mehrerer Gegenparteien vor seiner Fälligkeit beendet wird.
46	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Endgültiges vertragliches Abwicklungsdatum	Nicht aktualisierter Zeitpunkt gemäß dem Kontrakt, bis zu dem jede Übertragung von Barmitteln oder Vermögenswerten erfolgen sollte und die Gegenparteien keine ausstehenden Verbindlichkeiten mehr im Rahmen dieses Kontrakts haben sollten. Bei Produkten, bei denen es möglicherweise kein endgültiges vertragliches Abwicklungsdatum gibt (z. B. amerikanische Optionen), ist in dieses Datenelement das Datum der Übertragung von Barmitteln oder Vermögenswerten aufzunehmen, wenn die Beendigung am Fälligkeitstag erfolgen würde.
47	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Art der Lieferung	Angabe, ob der Kontrakt in physischer Form oder bar ausgeglichen wird.
48	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis	Im Derivategeschäft angegebener Preis. Dieser umfasst keine Gebühren, Steuern oder Provisionen. Ist der Preis bei Meldung einer neuen Transaktion nicht bekannt, wird der Preis aktualisiert, sobald die Information dazu verfügbar ist. Bei Transaktionen, die Teil eines Pakets sind, enthält dieses Datenelement gegebenenfalls den Preis des Komponentengeschäfts.
49	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises	Währung, in der der Preis angegeben ist. Die Währung des Preises gilt nur, wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird.



	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
	Die Felder 50 bis 52 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Preislisten auszufüllen.		
50	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Geltungsbeginn des Preises	Nicht aktualisierter Geltungsbeginn des Preises.
51	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Endtermin des Preises	Nicht aktualisierter Endtermin des Preises (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
52	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltender Preis zwischen dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn und dem Endtermin	Geltender Preis zwischen dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn und dem nicht aktualisierten Endtermin (diesen eingeschlossen).
53	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis des Transaktionspakets	Gehandelter Preis des gesamten Pakets, in dem das gemeldete Derivategeschäft eine Komponente bildet. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn — es sich nicht um ein Paket handelt oder — ein Spread des Transaktionspakets verwendet wird. Die Preise und damit verbundene Datenelemente der Transaktionen (Währung des Preises), die einzelne Komponenten des Pakets darstellen, werden gemeldet wenn sie verfügbar sind. Bei Meldung einer neuen Transaktion ist der Transaktionspreis des Pakets möglicherweise nicht bekannt; er kann aber zu einem späteren Zeitpunkt aktualisiert werden.
54	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises des Transaktionspakets	Währung, in der der Preis des Transaktionspakets angegeben ist. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn — es sich nicht um ein Paket handelt oder — ein Spread des Transaktionspakets verwendet wird oder — der Preis des Transaktionspakets als Prozentwert ausgedrückt wird.
55	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 1	Nennbetrag von Leg 1 gemäß Artikel 5 dieser Verordnung.
56	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 1	Falls zutreffend: die Währung, in der der Nennbetrag von Leg 1 angegeben ist.
	Die Felder 57 bis 59 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennbeträgen auszufüllen.		

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
57	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 1	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem der zugehörige Nennbetrag von Leg 1 wirksam wird.
58	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 1	Nicht aktualisierter Endtermin des Nennbetrags von Leg 1 (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
59	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Nennbetrag von Leg 1, der zum zugehörigen nicht aktualisierten Geltungsbeginn wirksam wird.
60	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 1	Aggregierte Nennmenge des Basiswerts von Leg 1 für die Laufzeit der Transaktion. Ist die gesamte Nennmenge bei Meldung einer neuen Transaktion nicht bekannt, wird die gesamte Nennmenge aktualisiert, sobald die Information dazu verfügbar ist.
	Die Felder 61 bis 63 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennmengen auszufüllen.		
61	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 1	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem der zugehörige Nennbetrag von Leg 1 wirksam wird
62	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 1	Nicht aktualisierter Endtermin der Nennmenge von Leg 1 (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
63	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Nennmenge von Leg 1, die zum zugehörigen nicht aktualisierten Geltungsbeginn wirksam wird.
64	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 2	Falls zutreffend: Nennbetrag von Leg 2 gemäß Artikel 5 dieser Verordnung.
65	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 2	Falls zutreffend: die Währung, in der der Nennbetrag von Leg 2 angegeben ist.
	Die Felder 66 bis 68 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennbeträgen auszufüllen.		

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
66	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 2	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem der zugehörige Nennbetrag von Leg 2 wirksam wird.
67	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 2	Nicht aktualisierter Endtermin des Nennbetrags von Leg 2 (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
68	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Nennbetrag von Leg 2, der zum zugehörigen nicht aktualisierten Geltungsbeginn wirksam wird.
69	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 2	Aggregierte Nennmenge des Basiswerts von Leg 2 für die Laufzeit der Transaktion. Ist die gesamte Nennmenge bei Meldung einer neuen Transaktion nicht bekannt, wird die gesamte Nennmenge aktualisiert, sobald die Information dazu verfügbar ist.
	Die Felder 70 bis 72 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennmengen auszufüllen.		
70	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 2	Nicht aktualisierter Zeitpunkt, zu dem die zugehörige Nennmenge von Leg 2 wirksam wird.
71	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 2	Nicht aktualisierter Endtermin der Nennmenge von Leg 2 (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
72	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Nennmenge von Leg 2, die zum zugehörigen nicht aktualisierten Geltungsbeginn wirksam wird.
	Der Abschnitt der Felder 73 bis 78 ist wiederholbar		
73	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art der sonstigen Zahlung	Art des sonstigen Zahlungsbetrags. Die Zahlung der Optionsprämie ist unter den Zahlungsarten nicht angeführt, da Optionsprämien unter Verwendung des Datenelements „Optionsprämie“ gemeldet werden.
74	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Betrag der sonstigen Zahlung	Zahlungsbeträge mit entsprechenden Zahlungsarten, um den Anforderungen an Transaktionsbeschreibungen aus verschiedenen Kategorien von Vermögenswerten Rechnung zu tragen.
75	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung der sonstigen Zahlung	Währung, in der der Betrag der sonstigen Zahlung angegeben ist.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
76	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Termin der sonstigen Zahlung	Nicht aktualisiertes Datum, an dem der Betrag der sonstigen Zahlung gezahlt wird.
77	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Zahler der sonstigen Zahlung	Kennung des Zahlers des Betrags der sonstigen Zahlung.
78	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Empfänger der sonstigen Zahlung	Kennung des Empfängers des Betrags der sonstigen Zahlung.
79	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz Leg 1 oder Kupon	Angabe des für Leg 1 geltenden Festsatzes oder Kupons, sofern anwendbar.
80	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Falls zutreffend: Zinsberechnungsmethode (oft auch als Berechnung des Zinsanteils oder Zinsberechnungsbasis bezeichnet), die bestimmt, wie Zinszahlungen berechnet werden. Sie dient der Berechnung des Jahresanteils des Berechnungszeitraums und gibt die Anzahl der Tage im Berechnungszeitraum an, dividiert durch die Anzahl der Tage im Jahr.
81	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des Festsatzes von Leg 1 oder Kupon.
82	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator für die Zahlungsfrequenz für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungstermine für den Festsatz von Leg 1 oder Kupon bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPT“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
83	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 1	Falls zutreffend: einen Identifikator für die verwendeten Zinssätze, die in im Voraus festgelegten Zeitabständen unter Bezugnahme auf einen marktüblichen Referenzzinssatz neu festgesetzt werden.
84	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 1	Angabe des Zinssatzes, sofern verfügbar.
85	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 1	Vollständiger Name des vom Indexanbieter zugewiesenen Zinssatzes.
86	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 1	Falls zutreffend: Zinsberechnungsmethode (oft auch als Berechnung des Zinsanteils oder Zinsberechnungsbasis bezeichnet), die bestimmt, wie die Zinszahlungen für den variablen Zinssatz von Leg 1 berechnet werden. Sie dient der Berechnung des Jahresanteils des Berechnungszeitraums und gibt die Anzahl der Tage im Berechnungszeitraum an, dividiert durch die Anzahl der Tage im Jahr.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
87	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des variablen Zinssatzes von Leg 1.
88	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungstermine für den variablen Zinssatz von Leg 1 bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPI“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
89	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite, Leg 1 – Zeitraum	Zeitspanne mit dem Referenzzeitraum bei der variablen Seite Leg 1.
90	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 1 – Multiplikator	Multiplikator der Zeitspanne mit dem Referenzzeitraum bei der variablen Seite Leg 1.
91	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Zeitraum	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungsrückstellungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des variablen Zinssatzes von Leg 1.
92	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Multiplikator	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungsrückstellungen für den variablen Zinssatz von Leg 1 bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPI“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
93	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 1	Angabe des Spread von Leg 1, sofern zutreffend: OTC-Derivatetransaktionen mit periodischen Zahlungen (z. B. Fix/Float-Zinsswaps, Basis-Swaps, Waren-/Rohstoff-Swaps), — Spread auf den Index-Referenzpreis des/der einzelnen variablen Leg(s), wenn es einen Spread auf einen oder mehrere Leg(s) gibt. — Differenz zwischen den Referenzpreisen der beiden variablen Leg-Indizes.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
94	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads von Leg 1	Falls zutreffend: die Währung, in der der Spread von Leg 1 angegeben ist. Dieses Datenelement gilt nur, wenn der Spread als monetärer Wert ausgedrückt wird.
95	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz von Leg 2	Angabe des für Leg 2 geltenden Festsatzes, sofern anwendbar.
96	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode Festsatz von Leg 2	Falls zutreffend: Zinsberechnungsmethode (oft auch als Berechnung des Zinsanteils oder Zinsberechnungsbasis bezeichnet), die bestimmt, wie Zinszahlungen berechnet werden. Sie dient der Berechnung des Jahresanteils des Berechnungszeitraums und gibt die Anzahl der Tage im Berechnungszeitraum an, dividiert durch die Anzahl der Tage im Jahr.
97	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 2	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des Festsatzes von Leg 2.
98	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz Festzinsseite von Leg 2	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungstermine für den Festsatz von Leg 2 bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPI“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
99	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 2	Falls zutreffend: einen Identifikator für die verwendeten Zinssätze, die in im Voraus festgelegten Zeitabständen unter Bezugnahme auf einen marktüblichen Referenzzinssatz neu festgesetzt werden
100	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 2	Angabe des Zinssatzes, sofern verfügbar.
101	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 2	Vollständiger Name des vom Indexanbieter zugewiesenen Zinssatzes.
102	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 2	Falls zutreffend: Zinsberechnungsmethode (oft auch als Berechnung des Zinsanteils oder Zinsberechnungsbasis bezeichnet), die bestimmt, wie die Zinszahlungen für den variablen Zinssatz von Leg 2 berechnet werden. Sie dient der Berechnung des Jahresanteils des Berechnungszeitraums und gibt die Anzahl der Tage im Berechnungszeitraum an, dividiert durch die Anzahl der Tage im Jahr.
103	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des variablen Zinssatzes von Leg 2.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
104	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungstermine für den variablen Zinssatz von Leg 2 bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPI“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
105	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite, Leg 2 – Zeitraum	Zeitspanne mit dem Referenzzeitraum bei der variablen Seite Leg 2.
106	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite, Leg 2 – Multiplikator	Multiplikator der Zeitspanne mit dem Referenzzeitraum bei der variablen Seite Leg 2.
107	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes, Leg 2 – Zeitraum	Falls zutreffend: Zeiteinheit für die Frequenz der Zahlungsrückstellungen, z. B. Tag, Woche, Monat, Jahr oder Laufzeit des variablen Zinssatzes von Leg 2.
108	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes, Leg 2 – Multiplikator	Falls zutreffend: Anzahl der Zeiteinheiten (ausgedrückt als Zahlungsfrequenz), die die Häufigkeit der regelmäßigen Zahlungsrückstellungen für den variablen Zinssatz von Leg 2 bestimmen. So wird beispielsweise eine Transaktion mit Zahlungen, die alle zwei Monate erfolgen, mit einer Zahlungsfrequenz von „MNTH“ (monatlich) und dem Multiplikator 2 dargestellt. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn die Zahlungsfrequenz „ADHO“ lautet. Bei der Zahlungsfrequenz „EXPI“ ist der Multiplikator die 1. Bezieht sich die Zahlungsfrequenz auf innerhalb eines Tages, dann ist dies mit „DAIL“ und dem Multiplikator 0 anzugeben.
109	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 2	Angabe des Spread von Leg 2, sofern zutreffend: OTC-Derivatetransaktionen mit periodischen Zahlungen (z. B. Fix/Float-Zinsswaps, Basis-Swaps, Waren-/Rohstoff-Swaps), — Spread auf den Index-Referenzpreis des/der einzelnen variablen Leg(s), wenn es einen Spread auf einen oder mehrere Leg(s) gibt. — Differenz zwischen den Referenzpreisen der beiden variablen Leg-Indizes.
110	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spread von Leg 2	Falls zutreffend: die Währung, in der der Spread von Leg 2 angegeben ist. Dieses Datenelement gilt nur, wenn der Spread als monetärer Wert ausgedrückt wird.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
111	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread des Transaktionspakets	<p>Gehandelter Preis des gesamten Pakets, in dem das gemeldete Derivategeschäft eine Komponente des Transaktionspakets bildet.</p> <p>Preis des Transaktionspakets; wenn der Preis des Pakets als Spread ausgedrückt wird, die Differenz zwischen zwei Referenzpreisen.</p> <p>Dieses Datenelement gilt nicht, wenn</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— es sich nicht um ein Paket handelt oder</li> <li>— der Preis des Transaktionspakets verwendet wird.</li> </ul> <p>Der Spread und damit verbundene Datenelemente der Transaktionen (Währung des Spread), die einzelne Komponenten des Pakets darstellen, werden gemeldet wenn sie verfügbar sind.</p> <p>Bei Meldung einer neuen Transaktion ist der Spread des Transaktionspakets möglicherweise nicht bekannt; er kann aber zu einem späteren Zeitpunkt aktualisiert werden.</p>
112	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads des Transaktionspakets	<p>Währung, in der der Spread des Transaktionspakets angegeben ist.</p> <p>Dieses Datenelement gilt nicht, wenn</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— es sich nicht um ein Paket handelt oder</li> <li>— der Preis des Transaktionspakets verwendet wird, oder</li> <li>— der Spread des Transaktionspakets als Prozentwert oder in Basispunkten ausgedrückt wird.</li> </ul>
113	Abschnitt 2i – Devisen	Wechselkurs 1	<p>Wechselkurs zwischen den beiden verschiedenen Währungen, die in dem von den Gegenparteien zu Beginn des Geschäfts vereinbarten Derivategeschäft angegeben sind, ausgedrückt als Wechselkurs aus der Umrechnung der Einheitswährung in die notierte Währung.</p>
114	Abschnitt 2i – Devisen	Devisenterminkurs	<p>Devisenterminkurs, wie zwischen den Gegenparteien in der vertraglichen Vereinbarung vereinbart. Anzugeben als Preis der Basiswährung in der notierten Währung.</p>
115	Abschnitt 2i – Devisen	Umrechnungsbasis	<p>Währungspaar und Reihenfolge, in der der Wechselkurs lautet, ausgedrückt als Währungseinheit oder notierte Währung.</p>
116	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Basisprodukt	<p>Basisprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.</p>
117	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Unterprodukt	<p>Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.</p> <p>Dieses Feld erfordert ein spezielles Basisprodukt in dem Feld.</p>
118	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Weiteres Unterprodukt	<p>Weiteres Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.</p> <p>Dieses Feld erfordert ein spezielles Unterprodukt in dem Feld.</p>



	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
119	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferpunkt oder -zone	Lieferpunkt(e) oder Marktgebiet(e).
120	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Kuppelstelle/Kopplungspunkt	Angabe der Grenze(n) oder Grenzübergänge eines Transportkontrakts.
121	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Art der Last	Angabe des Lieferprofils.
	Der Abschnitt der Felder 122 bis 131 ist wiederholbar		
122	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Startzeitpunkt des Lieferintervalls	Startzeitpunkt des Lieferintervalls für jeden Block oder jedes Profil.
123	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Endzeitpunkt des Lieferintervalls	Endzeitpunkt des Lieferintervalls für jeden Block oder jedes Profil.
124	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Startdatum der Lieferung	Startdatum der Lieferung.
125	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Enddatum der Lieferung	Enddatum der Lieferung.
126	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Laufzeit	Dauer des Lieferzeitraums.
127	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Wochentage	Wochentage, an denen die Lieferung erfolgt.
128	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferkapazität	Die Anzahl der Einheiten, die in der Transaktion für jedes in den Feldern 122 und 123 angegebene Lieferintervall enthalten sind.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
129	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Mengeneinheit	Verwendete Maßeinheit.
130	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Preis-/Zeitintervallmenge	Falls zutreffend, Preis pro Menge je Lieferzeitspanne.
131	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Währung der Preis-/Zeitintervallmenge	Währung, in der der Preis je Zeitintervallmenge ausgedrückt wird.
132	Abschnitt 2l – Optionen	Art der Option	<p>Angabe, ob es sich beim Derivatekontrakt um eine Call-Option (Berechtigung zum Erwerb eines spezifischen Basiswerts) oder eine Put-Option (Berechtigung zum Verkauf eines spezifischen Basiswerts) handelt oder ob zum Zeitpunkt der Ausführung des Derivatekontrakts nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt.</p> <p>Im Fall von Swaptions gilt Folgendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— „Put-Option“, wenn es sich um eine Receiver Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz empfängt.</li> <li>— „Call-Option“, wenn es sich um eine Payer Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz zahlt.</li> </ul> <p>Im Fall von Caps und Floors gilt Folgendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— „Put-Option“ im Falle eines Floors.</li> <li>— „Call-Option“ im Falle eines Caps.</li> </ul>
133	Abschnitt 2l – Optionen	Optionstyp	Gibt an, ob die Option ausschließlich zu einem bestimmten Termin (europäische Option), zu verschiedenen im Voraus festgelegten Terminen (Bermuda-Option) oder jederzeit vor ihrem Verfallsdatum (amerikanische Option) ausgeübt werden kann.
134	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Bei anderen Optionen als FX-Optionen, Swaptions und ähnlichen Produkten ist der Preis anzugeben, zu dem der Inhaber einer Option den Basiswert der Option kaufen oder verkaufen kann.</li> <li>— Bei Fremdwährungsoptionen ist der Wechselkurs, zu dem die Option ausgeübt werden kann, anzugeben, ausgedrückt als Wechselkurs aus der Umrechnung der Einheitswährung in die notierte Währung. Im Beispiel 0,9426 USD/EUR ist USD die Einheitswährung und EUR die notierte Währung; 1 USD = 0,9426 EUR. Ist der Preis bei Meldung einer neuen Transaktion nicht bekannt, wird der Preis aktualisiert, sobald die Information dazu verfügbar ist.</li> <li>— Bei Volatilitäts- und Varianzswaps und ähnlichen Produkten wird der Volatilitätsausübungspreis in diesem Datenelement gemeldet.</li> </ul>
	Die Felder 135 bis 137 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Ausübungspreisen auszufüllen.		

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
135	Abschnitt 2l – Optionen	Geltungsbeginn des Ausübungspreises	Nicht aktualisierter Geltungsbeginn des Ausübungspreises.
136	Abschnitt 2l – Optionen	Endtermin des Ausübungspreises	Nicht aktualisierter Endtermin des Ausübungspreises (entfällt, wenn der nicht aktualisierte Endtermin des Zeitraums einer bestimmten Liste mit dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn des Folgezeitraums übereinstimmt).
137	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn gilt	Ausübungspreis, der vom nicht aktualisierten Geltungsbeginn bis einschließlich dem nicht aktualisierten Endtermin gilt.
138	Abschnitt 2l – Optionen	Währung/ Währungspaar des Ausübungspreises	Bei Aktienoptionen, Waren-/Rohstoff-Optionen und ähnlichen Produkten die Währung, auf die der Ausübungspreis lautet. Für Devisenoptionen: Das Währungspaar und die Reihenfolge, in der der Ausübungspreis ausgedrückt wird. Sie wird als Einheitswährung je notierter Währung ausgedrückt.
139	Abschnitt 2l – Optionen	Betrag der Optionsprämie	Bei Optionen und Swaptions aller Kategorien von Vermögenswerten der vom Optionskäufer gezahlte Geldbetrag. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn das Instrument keine Option ist oder keine Option beinhaltet.
140	Abschnitt 2l – Optionen	Währung der Optionsprämie	Bei Optionen und Swaptions aller Kategorien von Vermögenswerten die Währung, auf die der Optionsprämienbetrag lautet. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn das Instrument keine Option ist oder keine Option beinhaltet.
141	Abschnitt 2l – Optionen	Zahlungstermin der Optionsprämie	Nicht aktualisiertes Datum, an dem die Optionsprämie gezahlt wird.
142	Abschnitt 2i – Optionen	Fälligkeitsdatum des Basiswerts	Bei Swaptions gilt der Fälligkeitstag des Basis-Swaps.
143	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Rang	Gibt den Rang des Schuldtitels oder des Schuldenkorbs an oder des Schuldenindexes, der einem Derivat zugrunde liegt.
144	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Referenzeinrichtung	Angabe der Referenzeinrichtung des Basiswerts.
145	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Serien	Die Seriennummer der Zusammensetzung des Index, sofern anwendbar.
146	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Version	Eine neue Version einer Serie wird herausgegeben, wenn eines der Bestandteile ausfällt und der Index neu gewichtet werden muss, um der neuen Anzahl aller Bestandteile des Index Rechnung zu tragen.
147	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Indexfaktor	Der auf den Nennbetrag (Feld 55 in dieser Tabelle) anzuwendende Faktor zur Anpassung des Nennbetrags an alle vorangegangenen Kreditereignisse in dieser Indexreihe.
148	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Tranche	Angabe, ob ein Derivatekontrakt in Tranchen unterteilt ist.
149	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Attachment-Point des Kreditderivat-Swap-Index (CDS-Index)	Definierter niedrigerer Punkt, an dem die Höhe der Verluste im Basis-Portfolio den Nennbetrag einer Tranche verringert. So wird beispielsweise der Nennbetrag in einer Tranche mit einem Attachment-Point von 3 % verringert, nachdem 3 % der Verluste im Portfolio eingetreten sind. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn es sich bei der Transaktion nicht um eine CDS-Tranche (Index- oder kundenspezifischen Korb) handelt.

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
150	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Detachment-Point des CDS-Index	Definierter Punkt, ab dem Verluste im Basis-Portfolio den Nennbetrag einer Tranche nicht mehr verringern. So wird beispielsweise der Nennbetrag in einer Tranche mit einem Attachment-Point von 3 % und einem Detachment-Point von 6 % verringert, nachdem 3 % der Verluste im Portfolio aufgetreten sind. Bei 6 % Verlusten im Portfolio ist der Nennwert der Tranche erschöpft. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn es sich bei der Transaktion nicht um eine CDS-Tranche (Index- oder kundenspezifischen Korb) handelt.
151	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Vorgangs	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Neu: Erstmalige Meldung eines Derivats auf Handels- oder Positionsebene.</li> <li>— Änderung: Eine Änderung der Bedingungen oder Einzelheiten eines zuvor gemeldeten Derivats auf Handels- oder Positionsebene, jedoch keine Korrektur einer Meldung.</li> <li>— Korrektur: Eine Meldung zur Berichtigung der fehlerhaften Datenfelder einer zuvor übermittelten Meldung.</li> <li>— Beendigung: Die Beendigung eines bestehenden Derivats auf Handels- oder Positionsebene.</li> <li>— Fehler: Die Annullierung einer ganzen Meldung, die irrtümlich gemacht wurde, wenn der Kontrakt auf Handels- oder Positionsebene nie zustande kam oder nicht unter die Meldepflicht nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 fiel, aber dennoch fälschlicherweise an ein Transaktionsregister gemeldet wurde; bzw. die Löschung einer Doppelmeldung.</li> <li>— Wiederherstellung: Wiedereröffnung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene, das mit Art des Vorgangs „Fehler“ annulliert oder versehentlich beendet wurde.</li> <li>— Bewertung: Die Aktualisierung der Bewertung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene</li> <li>— Positionskomponente: Die Meldung eines neuen Derivats, das in einer gesonderten Positionsmeldung am selben Tag enthalten ist.</li> </ul>
152	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Ereignisses	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Geschäft: Abschluss eines Derivats oder Neuaushandlung seiner Bedingungen, die nicht zu einer Änderung der Gegenpartei führen</li> <li>— Step-in: Ein Ereignis, bei dem das Derivat ganz oder teilweise auf eine Gegenpartei 2 übertragen (und als neues Derivat gemeldet) wird und das bestehende Derivat entweder beendet oder sein Nennbetrag geändert wird.</li> <li>— PTRR: Maßnahmen zur Verringerung von Nachhandelsrisiken</li> <li>— Vorzeitige Beendigung: Die Beendigung eines bestehenden Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene</li> <li>— Clearing: Clearing gemäß Artikel 2 Nummer 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012</li> <li>— Ausübung: Die vollständige oder teilweise Ausübung einer Option oder einer Swaption durch eine Gegenpartei der Transaktion.</li> <li>— Zuweisung: Zuweisungsereignis, bei dem ein bestehendes Derivat verschiedenen Gegenparteien zugeordnet wird und infolgedessen neue Derivate mit verringerten Nennbeträgen gemeldet werden.</li> <li>— Kreditereignis: Gilt nur für Kreditderivate. Ein Kreditereignis, das zur Änderung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene führt.</li> </ul>

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			<p>Unternehmensereignis: Ein auf das Eigenkapital bezogener Unternehmensvorgang, der sich auf die Derivate zu diesem Eigenkapital auswirkt.</p> <p>— Aufnahme in die Position: Aufnahme eines CCP-geclearten Derivats oder Differenzgeschäfts in eine Position, bei der ein bestehendes Derivat beendet wird und entweder eine neue Position geschaffen oder der Nennbetrag einer bestehenden Position geändert wird.</p> <p>Aktualisierung – Aktualisierung eines ausstehenden Derivats, das während des Übergangszeitraums durchgeführt wurde, um seine Übereinstimmung mit den geänderten Meldepflichten zu gewährleisten</p>
153	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Datum des Ereignisses	Datum, an dem das mit dem Derivatekontrakt in Zusammenhang stehende und in der Meldung erfasste meldepflichtige Ereignis eingetreten ist; bzw. im Falle einer Änderung: wann die Änderung wirksam wird.
154	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ebene	<p>Angabe, ob die Meldung auf Geschäfts- oder auf Positionsebene erfolgt.</p> <p>Eine Meldung auf Positionsebene kann lediglich als Ergänzung zur Meldung auf Transaktionsebene erfolgen, um Nachhandelsereignisse zu melden, und ist auf Fälle beschränkt, in denen die individuellen Geschäfte mit fungiblen Produkten durch die Position ersetzt wurden.</p>

(<sup>1</sup>) Delegierte Verordnung (EU) Nr. 149/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für indirekte Clearingvereinbarungen, die Clearingpflicht, das öffentliche Register, den Zugang zu einem Handelsplatz, nichtfinanzielle Gegenparteien und Risikominderungstechniken für nicht durch eine CCP geclearte OTC-Derivatekontrakte (ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 11).

Tabelle 3

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit der Übermittlung der Meldung an das Transaktionsregister.
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	<p>Hat die für die Meldung zuständige Stelle die Übermittlung der Meldung an einen Dritten oder die andere Gegenpartei delegiert, so wird diese Stelle in diesem Feld mittels einer einheitlichen Kennziffer angegeben.</p> <p>Andernfalls sollte in diesem Feld die für die Meldung zuständige Stelle angegeben werden.</p>
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	<p>Wenn eine finanzielle Gegenpartei gemäß Artikel 9 Absatz 1a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 allein die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen beider Gegenparteien trägt und die nichtfinanzielle Gegenpartei beschließt, die Einzelheiten ihrer mit der finanziellen Gegenpartei geschlossenen OTC-Derivatekontrakte nicht selbst zu melden, so ist die einheitliche Kennziffer zur Identifizierung dieser finanziellen Gegenpartei anzugeben.</p> <p>Trägt eine Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 9 Absatz 1b der genannten Verordnung die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (im</p>

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			Folgenden „OGAW“), so ist die einheitliche Kennziffer der Verwaltungsgesellschaft anzugeben. Trägt ein Verwalter alternativer Investmentfonds (im Folgenden „AIFM“) gemäß Artikel 9 Absatz 1c der genannten Verordnung die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung im Namen eines alternativen Investmentfonds, so ist die einheitliche Kennziffer des AIFM anzugeben. Trägt eine zugelassene Stelle, die für die Verwaltung einer EbAV verantwortlich ist und in ihrem Namen handelt, die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung in ihrem Namen gemäß Artikel 9 Absatz 1d der genannten Verordnung, so ist die einheitliche Kennziffer dieser Stelle anzugeben. Dieses Feld gilt nur für OTC-Derivate.
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (Meldende Gegenpartei)	Kenntung der Gegenpartei eines Derivategeschäfts, die ihre Meldepflicht über die betreffende Meldung erfüllt. Im Falle eines zugeordneten Derivategeschäfts, das von einem Fondsmanager im Namen eines Fonds durchgeführt wird, wird der Fonds und nicht der Fondsmanager als Gegenpartei gemeldet.
5	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	Angabe, ob die LEI zur Identifizierung der Gegenpartei 2 verwendet wurde.
6	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	Kenntung der zweiten Gegenpartei eines Derivategeschäfts. Im Falle eines zugeordneten Derivategeschäfts, das von einem Fondsmanager im Namen eines Fonds durchgeführt wird, wird der Fonds und nicht der Fondsmanager als Gegenpartei gemeldet.
7	Sicherheiten	Zeitstempel der Sicherheiten	Datum und Uhrzeit, ab dem die Sicherheitsleistungen gemeldet werden.
8	Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	Angabe, ob die Sicherung auf Portfoliobasis hinterlegt wurde. Unter „auf Portfoliobasis“ ist eine Reihe von Transaktionen zu verstehen, die zusammen (entweder auf Netto- oder auf Bruttobasis) verknüpft werden, im Gegensatz zu dem Szenario, in dem die Einschuss-/Nachschusszahlung für jede einzelne Transaktion separat berechnet und gebucht wird.
9	Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	Wenn Sicherheiten auf Portfoliobasis gemeldet werden, ist die einheitliche Kennziffer, die die Gegenpartei 1 dem Portfolio zuweist, anzugeben. Dieses Datenelement gilt nicht für Fälle, wenn die Besicherung auf Transaktionsebene erfolgt ist, wenn keine Besicherungsvereinbarung besteht oder wenn keine Sicherheit hinterlegt oder entgegengenommen wurde.
10	Sicherheiten	UTI	Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer gemäß Artikel 7 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.
11	Sicherheiten	Kategorie der Besicherung	Angabe, ob zwischen den Gegenparteien eine Sicherungsvereinbarung besteht. Dieses Datenelement wird für jede Transaktion oder jedes Portfolio angegeben, je nachdem, ob die Besicherung auf Transaktions- oder Portfolioebene erfolgt, und gilt sowohl für geclearte als auch für ungeclearte Transaktionen.

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
12	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (vor Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 hinterlegten Ersteinschusszahlung, einschließlich etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf die jeweilige Transaktion. Dieses Feld bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der Ersteinschusszahlung und nicht auf deren tägliche Veränderung.</p> <p>Das Datenelement bezieht sich sowohl auf nicht geclearte als auch auf zentral geclearte Transaktionen. Bei zentral geclearnten Transaktionen umfasst das Datenelement weder Beiträge zum Ausfallfonds noch Sicherheiten, die der CCP zur Erfüllung von Liquiditätsanforderungen, d. h. als zugesagte Kreditlinien, hinterlegt werden.</p> <p>Lautet die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
13	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (nach Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 hinterlegten Ersteinschusszahlung, einschließlich etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf die jeweilige Transaktion. Dieses Feld bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der Ersteinschusszahlung nach Anwendung des Abschlags (falls zutreffend) und nicht auf deren tägliche Veränderung.</p> <p>Das Datenelement bezieht sich sowohl auf nicht geclearte als auch auf zentral geclearte Transaktionen. Bei zentral geclearnten Transaktionen umfasst das Datenelement weder Beiträge zum Ausfallfonds noch Sicherheiten, die der CCP zur Erfüllung von Liquiditätsanforderungen, d. h. als zugesagte Kreditlinien, hinterlegt werden.</p> <p>Lautet die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
14	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung	<p>Währung, in der die hinterlegte Ersteinschusszahlung angegeben ist.</p> <p>Lautet die hinterlegte Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der hinterlegten Ersteinschusszahlungen umrechnen möchte.</p>
15	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (vor Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 hinterlegten Nachschusszahlung, einschließlich des Barausgleichs und etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind.</p>

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			<p>Die bedingte Nachschusszahlung ist darin nicht enthalten. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die hinterlegte Nachschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die hinterlegte Nachschusszahlung auf die jeweilige Transaktion. Dieses Feld bezieht sich auf den seit der ersten Meldung der für das Portfolio oder die Transaktion hinterlegten Nachschusszahlungen kumulierten, tatsächlichen Gesamtwert der Nachschusszahlung. Lautet die hinterlegte Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
16	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (nach Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 hinterlegten Nachschusszahlung, einschließlich des Barausgleichs und etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind. Die bedingte Nachschusszahlung ist darin nicht enthalten. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die hinterlegte Nachschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die hinterlegte Nachschusszahlung auf die jeweilige Transaktion. Dieses Feld bezieht sich auf den seit der ersten Meldung der für das Portfolio oder die Transaktion hinterlegten Nachschusszahlungen kumulierten, tatsächlichen Gesamtwert der Nachschusszahlung nach Anwendung des Abschlags, falls zutreffend. Lautet die hinterlegte Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
17	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung	<p>Währung, in der die hinterlegte Nachschusszahlung angegeben ist. Lautet die hinterlegte Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der hinterlegten Nachschusszahlungen umrechnen möchte.</p>
18	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte überschüssige Sicherheiten	<p>Monetärer Wert aller von Gegenpartei 1 hinterlegten zusätzlichen Sicherheiten, getrennt und unabhängig von den Ersteinschuss- und Nachschusszahlungen. Dieses Feld bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der überschüssigen Sicherheiten vor Anwendung des Abschlags, falls zutreffend, und nicht auf deren tägliche Veränderung. Jeder hinterlegte Ersteinschuss- oder Nachschussbetrag, der den geforderten Ersteinschuss oder geforderten Nachschuss übersteigt, wird als Teil der hinterlegten Ersteinschusszahlung bzw. der hinterlegten Nachschusszahlung gemeldet und nicht als hinterlegte überschüssige Sicherheit ausgewiesen. Bei zentral geclearten Transaktionen werden überschüssige Sicherheiten nur insoweit gemeldet, als sie einem bestimmten Portfolio oder einer bestimmten Transaktion zugeordnet werden können.</p>



Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
19	Sicherheiten	Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten	<p>Währung, in der die hinterlegten überschüssigen Sicherheiten angegeben sind.</p> <p>Lauten die hinterlegten überschüssigen Sicherheiten auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten umrechnen möchte.</p>
20	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Ersteinschusszahlung (vor Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 entgegengenommenen Ersteinschusszahlungen, einschließlich etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind.</p> <p>Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf die jeweilige Transaktion.</p> <p>Dieses Feld bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der Ersteinschusszahlung und nicht auf deren tägliche Veränderung.</p> <p>Das Datenelement bezieht sich sowohl auf nicht geclearte als auch auf zentral geclearte Transaktionen. Bei zentral geclearnten Transaktionen umfasst das Datenelement keine Sicherheiten, die die CCP im Rahmen ihrer Anlagetätigkeit entgegengenommen hat.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
21	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Ersteinschusszahlung (nach Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 entgegengenommenen Ersteinschusszahlungen, einschließlich etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind.</p> <p>Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf die jeweilige Transaktion.</p> <p>Dieses Feld bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der Ersteinschusszahlung nach Anwendung des Abschlags, falls zutreffend, und nicht auf deren tägliche Veränderung.</p> <p>Das Datenelement bezieht sich sowohl auf nicht geclearte als auch auf zentral geclearte Transaktionen. Bei zentral geclearnten Transaktionen umfasst das Datenelement keine Sicherheiten, die die CCP im Rahmen ihrer Anlagetätigkeit entgegengenommen hat.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
22	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen Ersteinschusszahlung	<p>Währung, in der die entgegengenommene Ersteinschusszahlung angegeben ist.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Ersteinschusszahlung auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der entgegengenommenen Ersteinschusszahlungen umrechnen möchte.</p>

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
23	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Nachschusszahlung (vor Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 entgegengenommenen Nachschusszahlung, einschließlich des Barausgleichs und etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind.</p> <p>Die bedingte Nachschusszahlung ist darin nicht enthalten. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die entgegengenommene Nachschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die entgegengenommene Nachschusszahlung auf die jeweilige Transaktion.</p> <p>Dieses Feld bezieht sich auf den seit der ersten Meldung der für das Portfolio oder die Transaktion entgegengenommenen Nachschusszahlungen kumulierten, tatsächlichen Gesamtwert der Nachschusszahlung.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
24	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Nachschusszahlung (nach Abschlag)	<p>Monetärer Wert der von der Gegenpartei 1 entgegengenommenen Nachschusszahlung, einschließlich des Barausgleichs und etwaiger Einschüsse, die sich im Transit befinden und noch nicht abgewickelt sind.</p> <p>Die bedingte Nachschusszahlung ist darin nicht enthalten. Erfolgt die Besicherung auf Portfolioebene, so bezieht sich die entgegengenommene Nachschusszahlung auf das gesamte Portfolio; wird die Besicherung für einzelne Transaktionen vorgenommen, so bezieht sich die entgegengenommene Nachschusszahlung auf die jeweilige Transaktion.</p> <p>Dieses Feld bezieht sich auf den seit der ersten Meldung der für das Portfolio/die Transaktion eingenommenen Nachschusszahlungen kumulierten, tatsächlichen Gesamtwert der Nachschusszahlung nach Anwendung des Abschlags, falls zutreffend.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so werden diese Beträge in eine von der Gegenpartei 1 gewählte einheitliche Währung umgerechnet und als ein Gesamtwert gemeldet.</p>
25	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen Nachschusszahlung	<p>Währung, in der die entgegengenommene Nachschusszahlung angegeben ist.</p> <p>Lautet die entgegengenommene Nachschusszahlung auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der entgegengenommenen Nachschusszahlungen umrechnen möchte.</p>
26	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene überschüssige Sicherheiten	<p>Monetärer Wert aller von der Gegenpartei 1 entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten, getrennt und unabhängig von den Ersteinschuss- und Nachschusszahlungen. Dieses Datenelement bezieht sich auf den tatsächlichen Gesamtwert der überschüssigen Sicherheiten vor Anwendung des Abschlags, falls zutreffend, und nicht auf deren tägliche Veränderung.</p> <p>Jeder entgegengenommene Ersteinschuss- oder Nachschussbetrag, der den geforderten Ersteinschuss oder geforderten Nachschuss übersteigt, wird als Teil der entgegengenommenen Ersteinschusszahlung bzw. der entgegengenommenen Nachschusszahlung gemeldet und nicht als entgegengenommene überschüssige Sicherheit ausgewiesen.</p>

Position	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
			Bei zentral geclearten Transaktionen werden überschüssige Sicherheiten nur insoweit gemeldet, als sie einem bestimmten Portfolio oder einer bestimmten Transaktion zugeordnet werden können.
27	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten	Währung, in der die entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten angegeben sind. Lauten die entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten auf mehr als eine Währung, so gibt dieses Datenelement eine dieser Währungen an, in die die Gegenpartei 1 alle Werte der entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten umrechnen möchte.
28	Sicherheiten	Art des Vorgangs	In der Meldung sind folgende Arten von Vorgängen anzugeben: a) eine neue Einschuss-/Nachschusszahlung oder eine Änderung der Einzelheiten der Einschuss-/Nachschusszahlung erfolgt unter „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen“; b) die Berichtigung von Datenfeldern, die in einer früheren Meldung falsch ausgefüllt wurden, erfolgt unter „Korrektur“.
29	Sicherheiten	Datum des Ereignisses	Datum, an dem das mit dem Derivatekontrakt in Zusammenhang stehende und in der Meldung erfasste meldepflichtige Ereignis eingetreten ist. Im Falle einer Aktualisierung der Sicherheiten: das Datum, zu dem die in der Meldung enthaltenen Informationen bereitgestellt werden.

**DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1856 DER KOMMISSION****vom 10. Juni 2022****zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013 festgelegten technischen Regulierungsstandards durch weitere Präzisierung des Verfahrens für den Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten sowie der technischen und operativen Vereinbarungen für diesen Zugang****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister<sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 81 Absatz 5 Unterabsatz 4 in Verbindung mit Artikel 81 Absatz 5 Unterabsatz 1 Buchstabe d

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Um Daten wirksam und effizient vergleichen und aggregieren zu können, sollten die Transaktionsregister bei der Gewährung des Zugangs zu den Einzelheiten von Derivaten und für die Kommunikation mit den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen Schemata aus XML-Formaten und -Nachrichten verwenden, die nach der ISO-20022-Methodik entwickelt wurden. Dies sollte die Transaktionsregister und relevanten Stellen nicht davon abhalten, sich auf die Verwendung anderer Formate als XML für die Kommunikation oder die Gewährung des Zugangs zu den Einzelheiten von Derivaten zu einigen.
- (2) Die Einzelheiten der gemeldeten Derivate, die die Transaktionsregister den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen anhand von Schemata in XML-Format gemäß ISO 20022 zur Verfügung stellen, sollten soweit anwendbar die gleichen Informationen enthalten, die von den Gegenparteien, den für die Meldung zuständigen Stellen und den die Meldung einreichenden Stellen bereitgestellt wurden.
- (3) Die Informationen, die den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen zugänglich sein sollten, sollten Einzelheiten von Derivaten umfassen, die von den Transaktionsregistern abgelehnt wurden, bzw. Einzelheiten von Derivaten, die von diesen akzeptiert wurden, für die sie jedoch eine Warnung abgegeben haben, sowie die Einzelheiten nach der Durchführung des Abgleichs für Derivate gemäß Artikel 19 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission<sup>(2)</sup>.
- (4) Hat die Kommission einen Durchführungsrechtsakt erlassen, in dem festgestellt wird, dass der Rechtsrahmen eines Drittlandes die Bedingungen des Artikels 76a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erfüllt, so sollte ein Transaktionsregister einer zuständigen Behörde dieses Drittlands unter Berücksichtigung des Mandats und der Zuständigkeiten der Drittlandsbehörde Zugang zu den Daten gewähren.
- (5) Um ein standardisiertes und harmonisiertes Vorgehen beim Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten sicherzustellen und den Verwaltungsaufwand sowohl für die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen als auch für die Transaktionsregister zu verringern, sollten die Aufgaben der Transaktionsregister bei der Gewährung des Zugangs zu den Einzelheiten von Derivaten näher präzisiert werden. Die Transaktionsregister sollten eine oder mehrere Personen benennen, die für die Kontakte mit den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen zuständig sind. Ferner sollten sie diesen Stellen auf ihrer Website Anweisungen bereitstellen und erläutern, wie der Zugang zu den im Besitz des Transaktionsregisters befindlichen Daten beantragt werden kann. Um diesen Stellen den Antrag auf Zugang zu den einschlägigen Daten zu erleichtern, sollten die Transaktionsregister außerdem ein standardisiertes Formular ausarbeiten; anhand dessen können die Stellen den Transaktionsregistern jene Informationen zur Verfügung stellen, die für die Einrichtung des Datenzugangs nötig sind. Die Transaktionsregister sollten schließlich die nötigen technischen Vorkehrungen treffen, damit die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen auf die Einzelheiten der gemeldeten Derivate zugreifen können.

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

<sup>(2)</sup> Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden (ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 25).

- (6) Die Delegierte Verordnung (EU) 151/2013 der Kommission <sup>(3)</sup> sollte daher entsprechend geändert werden.
- (7) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Regulierungsstandards, den die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde der Kommission nach Konsultation der Mitglieder des Europäischen Systems der Zentralbanken vorgelegt hat.
- (8) Die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde hat zu diesem Entwurf öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(4)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —
- (9) Um den Gegenparteien und Transaktionsregistern ausreichend Zeit für die Anpassung an die neuen Anforderungen der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission <sup>(5)</sup> zu geben, sollte der Zeitpunkt der Anwendung der Bestimmungen über die neuen Datenfelder verschoben werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

### Änderungen der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013

Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 wird wie folgt geändert:

1. Artikel 2 erhält folgende Fassung:

„Artikel 2

#### **Gewährung des Zugangs zu Einzelheiten von Derivaten**

(1) Ein Transaktionsregister stellt den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen gemäß den Artikeln 2 und 3 der vorliegenden Verordnung unmittelbar und unverzüglich Einzelheiten zu Derivaten zur Verfügung, auch wenn Delegationsvereinbarungen nach Artikel 28 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 bestehen.

Für die Zwecke von Unterabsatz 1 verwendet ein Transaktionsregister ein XML-Format und das nach der Methodik von ISO 20022 entwickelte Schema.

(2) Ein Transaktionsregister gewährleistet, dass die Transaktionsdaten über Derivate, die den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen gemäß diesem Artikel und den in den Artikeln 4 und 5 der vorliegenden Verordnung festgelegten Fristen zugänglich gemacht werden, Folgendes beinhalten:

- a) die Meldungen von Derivaten, die gemäß den Tabellen 1, 2 und 3 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission <sup>(\*)</sup> gemeldet werden, einschließlich des letzten Handelsstands ausstehender Derivate gemäß Artikel 2 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission <sup>(\*\*)</sup>;
- b) die einschlägigen Einzelheiten von Derivatemeldungen, die das Transaktionsregister am vorangegangenen Arbeitstag abgelehnt oder zu denen es eine Warnung abgegeben hat, und die Gründe für seine Ablehnung oder Warnung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission <sup>(\*\*\*)</sup>;
- c) den Stand des Abgleichs aller gemeldeten Derivate, für die das Transaktionsregister das Abgleichverfahren gemäß Artikel 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 durchgeführt hat.

<sup>(3)</sup> Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die von Transaktionsregistern zu veröffentlichenden und zugänglich zu machenden Daten sowie operationelle Standards für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten sowie den Datenzugang (ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 33).

<sup>(4)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(5)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung (siehe Seite 68 dieses Amtsblatts).

(3) Ein Transaktionsregister richtet für Stellen, die im Sinne von Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 verschiedene Aufgaben oder Mandate haben, einen zentralen Zugang zu allen unter ihre Aufgaben und Mandate fallenden Derivaten ein.

(4) Ein Transaktionsregister verschafft der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (im Folgenden ‚ESMA‘) Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, damit sie ihre Befugnisse gemäß ihren Aufgaben und Mandaten ausüben kann.

(5) Ein Transaktionsregister verschafft der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde, der Europäischen Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und dem Europäischen Ausschuss für Systemrisiken Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate.

(6) Ein Transaktionsregister verschafft der Agentur für die Zusammenarbeit der Energieregulierungsbehörden Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, sofern es sich beim Basiswert um Energie oder Emissionszertifikate handelt.

(7) Ein Transaktionsregister verschafft einer Behörde, die Handelsplätze beaufsichtigt, Zugang zu sämtlichen Transaktionsdaten zu allen an diesen Handelsplätzen ausgeführten Derivategeschäften.

(8) Ein Transaktionsregister verschafft einer gemäß Artikel 4 der Richtlinie 2004/25/EG benannten Aufsichtsbehörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, wenn der Basiswert ein Wertpapier ist, das von einer Gesellschaft ausgegeben wurde, die mindestens eine der folgenden Bedingungen erfüllt:

- a) die Gesellschaft ist zum Handel an einem geregelten Markt im Mitgliedstaat dieser Behörde zugelassen, und die Übernahmeangebote für die Wertpapiere dieser Gesellschaft fallen unter die Aufsichtsaufgaben und -mandate dieser Behörde,
- b) die Gesellschaft hat ihren satzungsmäßigen Sitz oder ihre Hauptverwaltung im Mitgliedstaat dieser Behörde, und die Übernahmeangebote für die Wertpapiere dieser Gesellschaft fallen unter die Aufsichtsaufgaben und -mandate dieser Behörde,
- c) die Gesellschaft ist im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Buchstabe c der Richtlinie 2004/25/EG ein Bieter um einer der unter Buchstabe a oder b dieses Absatzes genannten Gesellschaften und bietet dafür als Gegenleistung insbesondere auch Wertpapiere.

(9) Ein Transaktionsregister verschafft einer in Artikel 81 Absatz 3 Buchstabe j der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Behörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die Märkte, Kontrakte, Basiswerte, Referenzwerte und Gegenparteien betreffen, die unter die Aufsichtsaufgaben und -mandate dieser Behörde fallen.

(10) Ein Transaktionsregister verschafft der Europäischen Zentralbank (im Folgenden ‚EZB‘) und einem Mitglied des Europäischen Systems der Zentralbanken (im Folgenden ‚ESZB‘), dessen Währung der Euro ist, Zugang zu folgenden Daten:

- a) alle Transaktionsdaten von Derivaten in einem der folgenden Fälle:
  - i) wenn das Referenzunternehmen des Derivats in einem Mitgliedstaat niedergelassen ist, dessen Währung der Euro ist, und unter die Aufsichtszuständigkeiten und -mandate dieses ESZB-Mitglieds fällt,
  - ii) wenn es sich bei der Referenzverbindlichkeit um einen staatlichen Schuldtitel eines Mitgliedstaats handelt, dessen Währung der Euro ist,
- b) Positionsdaten zu Derivaten in Euro.

(11) Ein Transaktionsregister verschafft einer in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Behörde, die Systemrisiken für die Finanzstabilität im Euro-Raum überwacht und deren Mitgliedstaat ein Mitgliedstaat mit Euro-Währung ist, sowie der EZB Zugang zu allen Transaktionsdaten von Derivategeschäften, die an Handelsplätzen oder von zentralen Gegenparteien (im Folgenden ‚CCPs‘) oder solchen Gegenparteien abgeschlossen werden, die unter die Aufgaben und Mandate dieser Behörde fallen, wenn diese Systemrisiken für die Finanzstabilität im Euro-Währungsgebiet überwacht.

(12) Ein Transaktionsregister verschafft einem Mitglied des ESZB, dessen Währung nicht der Euro ist, Zugang zu folgenden Daten:

- a) alle Transaktionsdaten von Derivaten in einem der folgenden Fälle:
  - i) wenn das Referenzunternehmen des Derivats in einem Mitgliedstaat dieses ESZB-Mitglieds niedergelassen ist und dieses Unternehmen unter die Aufsichtszuständigkeiten und -mandate dieses ESZB-Mitglieds fällt,
  - ii) wenn es sich bei der Referenzverbindlichkeit um einen staatlichen Schuldtitel eines Mitgliedstaats dieses ESZB-Mitglieds handelt,

b) Positionsdaten zu Derivategeschäften, die auf die von dem betreffenden ESZB-Mitglied ausgegebene Währung lauten.

(13) Ein Transaktionsregister verschafft einer in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Behörde, die Systemrisiken für die Finanzstabilität überwacht und deren Mitgliedstaat ein Mitgliedstaat mit Euro-Währung ist, Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die an Handelsplätzen oder von CCPs oder solchen Gegenparteien abgeschlossen werden, die unter die Aufgaben und Mandate dieser Behörde fallen, wenn diese Systemrisiken für die Finanzstabilität in einem Mitgliedstaat überwacht, dessen Währung nicht der Euro ist.

(14) Ein Transaktionsregister verschafft der EZB, wenn diese ihre Aufgaben im Rahmen des einheitlichen Aufsichtsmechanismus gemäß der Verordnung (EU) Nr. 1024/2013 des Rates (\*\*\*) wahrnimmt, Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die von Gegenparteien abgeschlossen werden, die im Rahmen des einheitlichen Aufsichtsmechanismus gemäß der Verordnung von der EZB beaufsichtigt werden.

(15) Ein Transaktionsregister verschafft einer in Artikel 81 Absatz 3 Buchstaben o und p der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten zuständigen Behörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die von Gegenparteien abgeschlossen wurden, die unter die Aufgaben und Mandate dieser Behörde fallen.

(16) Ein Transaktionsregister verschafft einer in Artikel 81 Absatz 3 Buchstabe m der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Abwicklungsbehörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die von Gegenparteien abgeschlossen wurden, die unter die Aufgaben und Mandate dieser Behörde fallen.

(17) Ein Transaktionsregister verschafft dem Einheitlichen Abwicklungsausschuss (im Folgenden ‚SRB‘) Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, die von unter die Verordnung (EU) Nr. 806/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates (\*\*\*\*) fallenden Gegenparteien abgeschlossen werden.

(18) Ein Transaktionsregister verschafft einer Behörde, die eine zentrale Gegenpartei (CCP) beaufsichtigt, und dem entsprechenden Mitglied des ESZB das diese CCP beaufsichtigt, gegebenenfalls Zugang zu allen Transaktionsdaten zu von dieser CCP gelearnten Derivaten.

(\*) Delegierte Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates bezüglich technischer Regulierungsstandards, in denen die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister und die Art der zu verwendenden Meldungen festgelegt werden (ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 1).

(\*\*) Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung (ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 68).

(\*\*\*) Delegierte Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden (ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 46).

(\*\*\*\*) Verordnung (EU) Nr. 1024/2013 des Rates vom 15. Oktober 2013 zur Übertragung besonderer Aufgaben im Zusammenhang mit der Aufsicht über Kreditinstitute auf die Europäische Zentralbank (ABl. L 287 vom 29.10.2013, S. 63).

(\*\*\*\*\*) Verordnung (EU) Nr. 806/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Juli 2014 zur Festlegung einheitlicher Vorschriften und eines einheitlichen Verfahrens für die Abwicklung von Kreditinstituten und bestimmten Wertpapierfirmen im Rahmen eines einheitlichen Abwicklungsmechanismus und eines einheitlichen Abwicklungsfonds sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 (ABl. L 225 vom 30.7.2014, S. 1).“

2. In Artikel 3 wird folgender Absatz 3 hinzugefügt:

„(3) Im Verhältnis zu einer einschlägigen Behörde eines Drittstaates, für den die Kommission einen Durchführungsrechtsakt erlassen hat, in dem festgestellt wird, dass der Rechtsrahmen die Bedingungen des Artikels 76a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erfüllt, verschafft ein Transaktionsregister Zugang zu den Daten unter Berücksichtigung des Mandats und der Zuständigkeiten der Drittlandsbehörde.“

3. Artikel 4 erhält folgende Fassung:

„Artikel 4

#### **Gewährung des Zugangs zu Einzelheiten von Derivaten**

(1) Ein Transaktionsregister nimmt folgende Aufgaben wahr:

- a) es benennt eine oder mehrere Personen, die für die Kontakte mit den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen zuständig sind,
- b) es veröffentlicht auf seiner Website Anweisungen, die die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen zu befolgen haben, um einen Antrag auf Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten zu stellen,
- c) es stellt den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen ein Formular im Sinne des Absatzes 2 dieses Artikels zur Verfügung,
- d) es richtet den Zugang zu den Einzelheiten der Transaktionsdaten von Derivaten für die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen auf der Grundlage der Angaben ein, die in dem in Absatz 2 dieses Artikels genannten Formular zur Verfügung gestellt wurden,
- e) es richtet die technischen Vorkehrungen ein, die benötigt werden, damit die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen gemäß Absatz 2 dieses Artikels Zugang zu den Einzelheiten der Transaktionsdaten von Derivaten erhalten können,
- f) es verschafft den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen innerhalb von 30 Kalendertagen, nachdem diese einen Antrag auf Einrichtung eines solchen Zugangs gestellt haben, direkten und unmittelbaren Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten.

(2) Die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannte Stelle beantragt Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten, indem sie ein von einem Transaktionsregister entwickeltes und bereitgestelltes Formular verwendet und mindestens folgende Angaben macht:

- a) Name der Stelle,
- b) Kontaktperson bei der Stelle,
- c) rechtliche Verantwortlichkeiten und Mandate der Stelle,
- d) Anmeldedaten für eine sichere SSH-FTP-Verbindung,
- e) sonstige technische Angaben, die für den Zugang der Stelle zu den Einzelheiten von Derivaten relevant sind,
- f) ob die Stelle für Gegenparteien in ihrem Mitgliedstaat, im Euro-Raum oder in der Union zuständig ist,
- g) die Arten von Gegenparteien, für die die Stelle gemäß der Klassifizierung in Tabelle 1 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 zuständig ist.
- h) Arten von Basiswerten für Derivate, für die die Stelle zuständig ist,
- i) gegebenenfalls die von der Stelle beaufsichtigten Handelsplätze,
- j) gegebenenfalls die von der Stelle beaufsichtigten oder kontrollierten CCPs,
- k) gegebenenfalls die von der Stelle ausgegebene Währung,
- l) Liefer- und Zusammenschaltpunkte,
- m) die in der Union verwendeten Referenzwerte, deren Administrator unter der Aufsicht der Stelle steht,
- n) die Merkmale der vom Unternehmen beaufsichtigten Basiswerte,
- o) gegebenenfalls die Merkmale der in den Feldern 16 ‚Clearingmitglied‘ und 15 ‚Makler‘ in Tabelle 1 und in Feld 142 ‚Referenzunternehmen‘ in Tabelle 2 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 genannten Parteien, die von der Stelle beaufsichtigt werden.“

4. Artikel 5 wird wie folgt geändert:

- a) Absatz 4 wird gestrichen;



## b) Absatz 5 erhält folgende Fassung:

„(5) Ein Transaktionsregister schafft und erhält die technischen Voraussetzungen aufrecht, die erforderlich sind, um die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen in die Lage zu versetzen, vordefinierte regelmäßige Anträge auf Zugang zu den in den Artikeln 2 und 3 der vorliegenden Verordnung aufgeführten Einzelheiten von Derivaten einzurichten, die diese Stellen benötigen, um ihre Aufgaben und Mandate zu erfüllen.“

## c) Absatz 6 erhält folgende Fassung:

„(6) Auf Antrag verschafft ein Transaktionsregister den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführten Stellen Zugang zu Einzelheiten von Derivaten nach einer beliebigen Kombination der folgenden Felder gemäß dem Anhang der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860:

- a) Meldezeitstempel,
- b) Gegenpartei 1,
- c) Gegenpartei 2,
- d) für die Meldung zuständige Stelle,
- e) Unternehmenssektor der Gegenpartei 1,
- f) Art der Gegenpartei 1,
- g) Makler-ID,
- h) ID der meldenden Stelle,
- i) Kategorie von Vermögenswerten,
- j) Produktklassifizierung,
- k) Vertragsform,
- l) ISIN,
- m) eindeutige Produktkennung,
- n) Identifizierung des Basiswerts,
- o) Ausführungsplatz,
- p) Ausführungszeitstempel,
- q) Stichtag,
- r) Bewertungszeitstempel,
- s) Fälligkeitstermin,
- t) Datum der vorzeitigen Beendigung,
- u) CCP,
- v) Clearingmitglied,
- w) Ebene,
- x) Art des Vorgangs,
- y) Ereignisart.“

## d) Absatz 7 erhält folgende Fassung:

„(7) Ein Transaktionsregister schafft und erhält die technischen Voraussetzungen aufrecht, die erforderlich sind, um den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen den direkten und sofortigen Zugang zu den Einzelheiten von Derivaten zu gewähren, den die genannten Stellen im Hinblick auf die Erfüllung ihrer Aufgaben und Mandate benötigen. Dieser Zugang wird in folgender Weise gewährt:

- a) wenn eine in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführte Stelle Zugang zu Einzelheiten zu ausstehenden Derivaten oder zu Derivaten beantragt, die entweder fällig sind oder für die maximal ein Jahr vor Antragstellung Meldungen mit Art des Vorgangs ‚Fehler‘, ‚Beendigung‘ oder ‚Positionskomponente‘ im Sinne von Feld 151 in Tabelle 2 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 vorgenommen worden sind oder die Gegenstand einer Meldung mit Art des Vorgangs ‚Wiederherstellung‘ sind, auf die keine Meldung mit Art des Vorgangs ‚Fehler‘ oder ‚Beendigung‘ folgte; ein Transaktionsregister kommt diesem Antrag bis spätestens 12.00 Uhr koordinierte Weltzeit am ersten Kalendertag nach dem Tag, an dem der jeweilige Antrag auf Zugang übermittelt wurde, nach;

- b) wenn eine in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 aufgeführte Stelle Zugang zu Einzelheiten von Derivaten, die entweder fällig sind oder für die mehr als ein Jahr vor Antragstellung Meldungen mit Art des Vorgangs ‚Fehler‘, ‚Beendigung‘ oder ‚Positionskomponente‘ im Sinne von Feld 151 in Tabelle 2 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 vorgenommen worden sind oder die Gegenstand einer Meldung mit Art des Vorgangs ‚Wiederherstellung‘ sind, auf die keine Meldung mit Art des Vorgangs ‚Fehler‘ oder ‚Beendigung‘ folgte; ein Transaktionsregister kommt diesem Antrag innerhalb von drei Arbeitstagen nach dem Tag, an dem der jeweilige Antrag auf Zugang übermittelt wurde, nach;
- c) bezieht sich der Antrag auf Datenzugang einer in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stelle auf Derivate, die sowohl unter den Buchstaben a als auch unter den Buchstaben b dieses Absatzes fallen, stellt das Transaktionsregister die Einzelheiten zu den jeweiligen Derivaten innerhalb von drei Arbeitstagen nach dem Tag, an dem der jeweilige Antrag auf Zugang übermittelt wurde, bereit.“

#### Artikel 2

#### **Inkrafttreten**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Artikel 1 Absatz 4 Buchstaben c und d gelten ab dem 29. April 2024.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN

**DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1857 DER KOMMISSION****vom 10. Juni 2022****zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 festgelegten technischen Regulierungsstandards im Hinblick auf die Einzelheiten der Anträge auf Registrierung als Transaktionsregister und Anträge auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 56 Absatz 3 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) In der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission <sup>(2)</sup> sind die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt.
- (2) Mit Inkrafttreten der Verordnung (EU) 2019/834 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(3)</sup> müssen Transaktionsregister über Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten verfügen. Um sicherstellen, dass die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde über die einschlägigen Informationen verfügt, anhand deren sie bei der Bewertung des Antrags auf Registrierung eines Transaktionsregisters überprüfen kann, ob ein Transaktionsregister diese Anforderungen erfüllt, sollten Transaktionsregister verpflichtet sein, Informationen über die von ihnen eingerichteten Verfahren bereitzustellen, um gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission <sup>(4)</sup> die auf die Daten zugreifenden Nutzer zu authentifizieren, den relevanten Stellen über die Befugnis der einreichenden Stelle Rückmeldung zu geben, die Vollständigkeit und Richtigkeit der Daten, den Abgleich und die Ergebnisse des Abgleichs zu überprüfen, eine Warnmeldung an die einreichenden Stellen zu übermitteln und Rechtsträgerkennungen zu ändern.
- (3) Um sicherzustellen, dass die Transaktionsregister die höchsten Regulierungsstandards erfüllen, müssen zusätzliche Vorschriften für die Informationen über die Verfahren zur Übertragbarkeit, über die IT-Fragen, die sich auf die Datenqualität auswirken, und für das Meldeprotokoll eingeführt werden.

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

<sup>(2)</sup> Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden (AbL. L 52 vom 23.2.2013, S. 25).

<sup>(3)</sup> Verordnung (EU) 2019/834 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Mai 2019 zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 in Bezug auf die Clearingpflicht, die Aussetzung der Clearingpflicht, die Meldepflichten, die Risikominderungsstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei geclearte OTC-Derivatekontrakte, die Registrierung und Beaufsichtigung von Transaktionsregistern und die Anforderungen an Transaktionsregister (AbL. L 141 vom 28.5.2019, S. 42).

<sup>(4)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden (siehe Seite 46 dieses Amtsblatts).

- (4) Die Einzelheiten eines vereinfachten Antrags auf Ausweitung der Registrierung sollten festgelegt werden, damit Transaktionsregister, die bereits nach der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(5)</sup> registriert sind, eine Ausweitung ihrer Registrierung gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 beantragen können. Um Doppelanforderungen zu vermeiden, sollten Transaktionsregister, die eine Ausweitung der Registrierung beantragen, lediglich Informationen über die Anpassungen ihrer Systeme, Verfahren und Ressourcen, die für die Erfüllung der Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erforderlich sind, bereitstellen müssen.
- (5) Die Zahlung der fälligen Gebühren durch Transaktionsregister bei der Einreichung des Antrags auf Registrierung oder Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister ist von wesentlicher Bedeutung, um die Kosten der ESMA im Zusammenhang mit dieser Registrierung oder Ausweitung der Registrierung zu decken. Der Antrag sollte daher einen Zahlungsnachweis enthalten.
- (6) Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 sollte daher entsprechend geändert werden.
- (7) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde vorgelegt wurde.
- (8) Die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde hat zu diesem Entwurf öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(6)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —
- (9) Damit die Transaktionsregister alle erforderlichen Maßnahmen ergreifen können, um sich an die mit dieser Verordnung eingeführten Änderungen der Anforderungen an die Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der Daten anzupassen, sollte der Geltungsbeginn dieser Bestimmungen verschoben werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 wird wie folgt geändert:

1. Artikel 19 erhält folgende Fassung:

„Artikel 19

#### **Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der Daten**

„Ein Antrag auf Registrierung als Transaktionsregister enthält Informationen zu Folgendem:

- a) Verfahren zur Authentifizierung der auf das Transaktionsregister zugreifenden Nutzer gemäß Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission (\*),
- b) Verfahren zur Überprüfung der Konformität des für die Meldung von Derivaten an das Transaktionsregister verwendeten XML-Schemas mit der ISO-20022-Methodik gemäß Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,
- c) Verfahren zur Überprüfung der Zulassung der Stelle, die die Meldung im Namen der meldenden Gegenpartei vornimmt gemäß Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,

<sup>(5)</sup> Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1).

<sup>(6)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

- d) Verfahren zur Überprüfung, ob die logische Reihenfolge der Einzelheiten der gemeldeten Derivate jederzeit eingehalten wird gemäß Artikel 1 Absatz 1 Buchstaben d bis k der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,
- e) Verfahren zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der Einzelheiten der gemeldeten Derivategeschäfte gemäß Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe l der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,
- f) Verfahren zum Datenabgleich gemäß Artikel 3 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,
- g) Verfahren für Rückmeldungen an die Gegenparteien der Derivate, die für die Meldung zuständigen Stellen oder die Dritten, die Meldungen in deren Namen vornehmen, zu den nach den Buchstaben a bis e durchgeführten Überprüfungen gemäß Artikel 1 Absatz 3 und Artikel 4 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 und zu den Ergebnissen des nach Buchstabe f durchgeführten Abgleichs gemäß Artikel 3 Absatz 5 und Artikel 4 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858,
- h) Verfahren für die Übermittlung von Warnmeldungen an die Gegenparteien der Derivate, die für die Meldung zuständigen Stellen oder die Dritten, die Meldungen in deren Namen vornehmen, über die gemäß Artikel 4 Absatz 1 Buchstaben e bis g der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 durchgeführten Überprüfungen,
- i) Verfahren für die Aktualisierung der Rechtsträgerkennungen gemäß Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858.

(\*) Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden (ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 46).“

2. Artikel 21 Absatz 2 erhält folgende Fassung:

„(2) Ein Antrag auf Registrierung als Transaktionsregister enthält die Verfahren, mit denen die ordnungsgemäße Ersetzung des ursprünglichen Transaktionsregisters sichergestellt wird, wenn eine Ersetzung von einer meldenden Gegenpartei, einer für die Meldung zuständigen Stelle oder von einem Dritten, der die Meldung im Namen nicht meldender Gegenparteien vornimmt, verlangt wird oder wenn eine solche Ersetzung das Resultat eines Widerrufs der Registrierung ist, einschließlich der Verfahren für den Datentransfer und die Umleitung der Meldungen an ein anderes Transaktionsregister.“

3. Artikel 22 Absatz 1 Buchstabe b erhält folgende Fassung:

„b) Aufzeichnungen über alle gemeldeten Informationen im Zusammenhang mit dem Abschluss, der Änderung oder der Beendigung eines Derivatekontrakts in einem Meldeprotokoll, in dem die die Maßnahme beantragende(n) Person(en), gegebenenfalls auch das Transaktionsregister selbst, die Gründe für diese Maßnahme, Datum und Uhrzeit der Maßnahme sowie alte und neue Daten gemäß dem Anhang der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission (\*) angegeben sind;

(\*) Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung (ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 68).“

4. Artikel 23 Buchstabe b erhält folgende Fassung:

„b) eine Beschreibung der Ressourcen, Methoden und Einrichtungen, die das Transaktionsregister nutzt, um für die einschlägigen Behörden den Zugang zu seinen Daten über die Einzelheiten von Derivatekontrakten gemäß Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zu erleichtern, ein Protokoll über die IT-Probleme bei den Transaktionsregistern, die sich auf die Qualität der den einschlägigen Behörden gemäß Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zur Verfügung gestellten Daten auswirken, und die Beschreibung der Aktualisierungshäufigkeit sowie der Kontrollen und Überprüfungen, die das Transaktionsregister möglicherweise für die Prozesse der Zugangsfilterung einrichtet, samt einer Kopie jeglicher diesbezüglichen Handbücher und internen Verfahren;“

5. Nach Artikel 23a wird folgende Überschrift von Kapitel 2 eingefügt:

„KAPITEL 2

**AUSWEITUNG EINER REGISTRIERUNG“.**

6. Folgender Artikel 23b wird eingefügt:

„Artikel 23b

**Ausweitung einer Registrierung**

Der Antrag auf Ausweitung einer bestehenden Registrierung gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates (\*) enthält die Angaben gemäß Artikel 1 ausgenommen Absatz 2 Buchstabe k, Artikel 2 und 5, Artikel 7, ausgenommen Absatz 2 Buchstabe d, Artikel 8 Buchstabe b, Artikel 9 Absatz 1 Buchstaben b und e, Artikel 11, Artikel 12 Absatz 2, Artikel 13, Artikel 14 Absatz 2, Artikel 15, Artikel 16 ausgenommen Buchstabe c, Artikel 17 bis 23a und Artikel 23c.

(\*) Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1).“.

7. Nach Artikel 23b wird folgende Überschrift von Kapitel 3 eingefügt:

„KAPITEL 3

**GEBÜHREN UND ÜBERPRÜFUNG“.**

8. Folgender Artikel 23c wird eingefügt:

„Artikel 23c

**Zahlung von Gebühren**

Ein Antrag auf Registrierung oder Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister muss einen Nachweis über die Zahlung der entsprechenden Registrierungs- oder Ausweitungsgebühren gemäß der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 1003/2013 der Kommission (\*) enthalten.

(\*) Delegierte Verordnung (EU) Nr. 1003/2013 der Kommission vom 12. Juli 2013 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die Gebühren, die den Transaktionsregistern von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde in Rechnung gestellt werden (ABl. L 279 vom 19.10.2013, S. 4).“.

9. Artikel 24 Absatz 1 erhält folgende Fassung:

„(1) Allen Angaben, die der ESMA im Laufe des Verfahrens zur Registrierung oder zur Ausweitung der Registrierung übermittelt werden, ist ein von einem Mitglied des Leitungsorgans und der Geschäftsleitung des Transaktionsregisters unterzeichnetes Schreiben beizufügen, in dem bestätigt wird, dass die übermittelten Angaben zum Zeitpunkt der Vorlage ihres Wissens richtig und vollständig sind.“

*Artikel 2*

**Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im Amtsblatt der Europäischen Union in Kraft.**

Artikel 1 Absatz 1 gilt ab dem 29 April 2024.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN

---

**DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1858 DER KOMMISSION****vom 10. Juni 2022**

**zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden**

**(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 78 Absatz 10,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Um bei den Einzelheiten von Derivaten, die den Transaktionsregistern übermittelt werden, eine hohe Datenqualität zu gewährleisten, sollten Transaktionsregister die Richtigkeit der Angaben über die meldende Stelle, die logische Konsistenz der Meldesequenz der Einzelheiten von Derivaten und die Vollständigkeit und Richtigkeit dieser Einzelheiten überprüfen.
- (2) Aus dem gleichen Grund sollten Transaktionsregister die Einzelheiten jeder eingegangenen Derivatemeldung abgleichen, wenn beide Gegenparteien einer Meldepflicht unterliegen. Damit die Transaktionsregister diesen Abgleich auf konsistente Weise durchführen können, und zur Minderung des Risikos, dass bei bestimmten Einzelheiten von Derivaten von einem Abgleich abgesehen wird, sollte ein standardisiertes Verfahren festgelegt werden. Aufgrund der Besonderheiten der von den meldenden Stellen genutzten technischen Systeme weichen bestimmte Einzelheiten von Derivaten jedoch möglicherweise voneinander ab. Damit geringfügige Differenzen bei den gemeldeten Einzelheiten von Derivaten die Behörden nicht daran hindern, die Daten mit einem angemessenen Konfidenzniveau zu analysieren, müssen deshalb bestimmte Toleranzen festgelegt werden.
- (3) Darüber hinaus sollten die Transaktionsregister ungeachtet anderer Verpflichtungen in Bezug auf die Einzelheiten von Derivaten, die bei der Durchführung des Abgleichs erhoben und aufgezeichnet werden, die Vertraulichkeit der Daten gewährleisten, die zwischen ihnen ausgetauscht und den meldenden Gegenparteien, den für die Meldung zuständigen Stellen und den die Meldung einreichenden Stellen zur Verfügung gestellt wurden.
- (4) Erfolgt eine Unternehmensumstrukturierung, die zur Änderung der Rechtsträgerkennung (LEI) einer Gegenpartei führt, müssen die Angaben zu den in einer Derivatemeldung identifizierten Unternehmen aktualisiert werden. Um die Integrität dieser Informationen sicherzustellen, die für die Überwachung der Systemrisiken für die Finanzstabilität von wesentlicher Bedeutung sind, ist es erforderlich, dass die Aktualisierung zentral von den Transaktionsregistern vorgenommen wird. Aus diesem Grund sollte ein Verfahren eingeführt werden, mit dem sichergestellt wird, dass die Transaktionsregister die Kennung des Unternehmens zentral aktualisieren können und damit eine effiziente, belastbare und zeitnahe Vorgehensweise besteht.
- (5) Um insbesondere zu verhindern, dass unmittelbar nach Geltungsbeginn der Meldepflicht eine große Zahl nicht abgeglichener Geschäfte aufläuft, sollte den meldenden Stellen zur Anpassung an die Meldeanforderungen genügend Zeit eingeräumt werden. In einer ersten Phase sollte daher nur eine beschränkte Zahl von Daten abgeglichen werden.

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.



- (6) Die meldenden sowie gegebenenfalls die für die Meldung verantwortlichen Stellen sollten verfolgen können, ob sie ihre Meldepflichten nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erfüllen. Aus diesem Grund sollten sie täglich auf bestimmte, diese Meldungen betreffende Angaben zugreifen können, wozu auch das Ergebnis der Überprüfung dieser Meldungen, auch im Fall einer Warnung, sowie die Fortschritte beim Abgleich der gemeldeten Daten zählen. Aus diesem Grund sollte festgelegt werden, welche Angaben ein Transaktionsregister diesen Stellen am Ende jedes Arbeitstages zur Verfügung stellen sollte.
- (7) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde vorgelegt wurde.
- (8) Die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde hat zu diesem Entwurf eine Konsultation der Mitglieder des Europäischen Systems der Zentralbanken und öffentliche Konsultationen zu dem dieser Verordnung zugrundeliegenden Entwurf technischer Regulierungsstandards durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(2)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —
- (9) Damit die Gegenparteien und Transaktionsregister alle erforderlichen Maßnahmen zur Anpassung an die neuen Anforderungen ergreifen können, sollte der Geltungsbeginn dieser Verordnung um 18 Monate verschoben werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

### Überprüfung der Derivate durch die Transaktionsregister

- (1) Ein Transaktionsregister überprüft eine erhaltene Derivatemeldung in allen folgenden Punkten:
  - a) die Identität der die Meldung einreichenden Stelle gemäß dem Feld 2 der Tabelle 1 und dem Feld 2 der Tabelle 3 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission <sup>(3)</sup>;
  - b) dass das für die Meldung eines Derivats verwendete XML-Schema der ISO 20022-Methodik gemäß Artikel 1 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 entspricht;
  - c) dass die die Meldung einreichende Stelle, falls sie mit der für die Meldung gemäß Feld 3 der Tabelle 1 und Feld 3 der Tabelle 3 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 zuständigen Stelle nicht identisch ist, ordnungsgemäß befugt ist, die Meldung im Namen der Gegenpartei 1 oder der für die Meldung zuständigen Stelle zu erstatten, falls diese mit der Gegenpartei 1 gemäß Feld 4 der Tabelle 1 und Feld 4 der Tabelle 3 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 nicht identisch ist;
  - d) dass dasselbe Derivat nicht bereits gemeldet wurde;
  - e) dass sich eine Derivatemeldung mit der Art des Vorgangs „Modifikation“, „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlung“, „Bewertung“, „Korrektur“, „Fehler“ oder „Beendigung“ auf ein zuvor gemeldetes Derivat bezieht;
  - f) dass sich eine Derivatemeldung mit der Art des Vorgangs „Modifikation“ nicht auf ein Derivat bezieht, das als annulliert mit der Art des Vorgangs „Fehler“ gemeldet wurde und anschließend nicht mit der Art des Vorgangs „Wiederherstellung“ gemeldet wurde;
  - g) dass sich in einer Derivatemeldung die Art des Vorgangs „Neu“ nicht auf ein Derivat bezieht, das bereits gemeldet worden ist;

<sup>(2)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(3)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung (siehe Seite 68 dieses Amtsblatts).

- h) dass sich in einer Derivatemeldung die Art des Vorgangs „Positionskomponente“ nicht auf ein Derivat bezieht, das bereits gemeldet worden ist;
- i) dass eine Derivatemeldung nicht darauf abzielt, die Angaben in den Feldern „Gegenpartei 1“ oder „Gegenpartei 2“ eines zuvor gemeldeten Derivats zu ändern;
- j) dass eine Derivatemeldung nicht darauf abzielt, ein bestehendes Derivat durch Angabe eines Geltungsbeginns zu ändern, das nach dem gemeldeten Fälligkeitsdatum liegt;
- k) dass sich ein Derivat, das mit der Art des Vorgangs „Wiederherstellung“ gemeldet wurde, auf eine zuvor übermittelte Derivatemeldung mit der Art des Vorgangs „Fehler“ oder „Beendigung“ bezieht bzw. auf ein Derivat, das fällig geworden ist;
- l) die Richtigkeit und Vollständigkeit der Derivatemeldung.

(2) Eine Derivatemeldung, die eine der in Absatz 1 genannten Anforderungen nicht erfüllt, wird vom Transaktionsregister zurückgewiesen und einer der in Tabelle 1 des Anhangs genannten Kategorien für die Ablehnung zugeordnet.

(3) Ein Transaktionsregister legt den die Meldung einreichenden Stellen innerhalb von 60 Minuten nach Erhalt einer Derivatemeldung detaillierte Informationen über die Ergebnisse der in Absatz 1 genannten Datenüberprüfung vor. Diese Ergebnisse stellt das Transaktionsregister in einem XML-Format und einem Schema gemäß der ISO-20022-Methodik bereit. In den Ergebnissen sind die Gründe für die Ablehnung einer Derivatemeldung gemäß Tabelle 1 des Anhangs anzugeben.

## Artikel 2

### Verfahren für die Aktualisierung der Rechtsträgerkennung

(1) Ein Transaktionsregister, an das ein Antrag gemäß Artikel 8 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 gerichtet wird, identifiziert die ausstehenden Derivate im Sinne des Artikels 2 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 zum Zeitpunkt des Unternehmensumstrukturierungsereignisses, wenn das Unternehmen mit der vor der Unternehmensumstrukturierung verwendeten Kennung im Feld „Gegenpartei 1“ oder „Gegenpartei 2“ gemeldet wird, wie dem betreffenden Antrag zu entnehmen ist. Es ersetzt die alte Kennung durch die neue Rechtsträgerkennung (im Folgenden „LEI“) in den Meldungen, die sich auf alle diese Derivate zum Zeitpunkt des in Artikel 8 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 genannten Ereignisses in Bezug auf diese Gegenpartei beziehen. Ein Transaktionsregister führt das Verfahren zur Aktualisierung der Kennung spätestens am Tag der Umstrukturierung oder innerhalb von 30 Kalendertagen nach Eingang des Antrags durch, wenn die Meldung weniger als 30 Kalendertage vor dem Datum der Unternehmensumstrukturierung erfolgt.

(2) Ein Transaktionsregister ermittelt die relevanten Derivate im Sinne des Artikels 2 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 zum Zeitpunkt des Unternehmensumstrukturierungsereignisses, wenn das Unternehmen in einem der Felder mit der alten Kennung identifiziert wird, und ersetzt diese Kennung durch die neue LEI. Ist die Unternehmensumstrukturierung mit einer Aktualisierung der LEI für andere Felder als „Gegenpartei 1“ oder „Gegenpartei 2“ verbunden, führt das Transaktionsregister eine solche Aktualisierung der betreffenden Derivate erst nach einer zeitnahen Bestätigung durch die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung zuständige Stelle durch.

(3) Ein Transaktionsregister führt Folgendes durch:

- a) nach Eingang der entsprechenden Bestätigung gemäß Absatz 2 führt es die Aktualisierung der LEI ab dem in Absatz 1 genannten Zeitpunkt durch;
- b) es übermittelt die folgenden Informationen so früh wie möglich, spätestens jedoch fünf Arbeitstage nach Eingang der vollständigen Meldung, an alle anderen Transaktionsregister und die meldenden Gegenparteien, die die Meldung einreichenden Stellen, die für die Meldung zuständigen Stellen, die an den von der LEI-Aktualisierung betroffenen Derivatekontrakten beteiligt sind, und gegebenenfalls an Dritte, denen gemäß Artikel 78 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 Zugang zu den Informationen gewährt wurde:
  - i) die alte(n) Kennung(en),
  - ii) die neue Kennung,
  - iii) das Datum, ab dem die Aktualisierung vorzunehmen ist,
  - iv) im Falle von Unternehmensereignissen, die eine Untergruppe der zum Zeitpunkt des Ereignisses ausstehenden Derivate betreffen, die Liste der eindeutigen Geschäftsabschluss-Kennziffern (im Folgenden „UTI“) der von der LEI-Aktualisierung betroffenen Derivate,

- c) es verständigt die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen, die Zugang zu den Daten zu den aktualisierten Derivaten haben, spätestens am Arbeitstag vor dem Datum der Anwendung der Aktualisierung in einer speziellen Datei in maschinenlesbarem Format über Folgendes:
- i) die alte(n) Kennung(en),
  - ii) die neue Kennung,
  - iii) das Datum, ab dem die Aktualisierung vorzunehmen ist,
  - iv) im Falle von Unternehmensereignissen, die eine Untergruppe der zum Zeitpunkt des Ereignisses ausstehenden Derivate betreffen, die Liste der UTI der von der LEI-Aktualisierung betroffenen Derivate,
- d) es trägt die LEI-Aktualisierung in das Meldeprotokoll ein.

(4) Ein Transaktionsregister aktualisiert nicht die für Derivate gemeldeten LEI, die sich zum Zeitpunkt des Unternehmensereignisses von den in Artikel 2 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860 genannten unterscheiden.

### Artikel 3

#### **Datenabgleich durch die Transaktionsregister**

(1) Ein Transaktionsregister bemüht sich um Abgleich eines gemeldeten Derivats und führt dazu die in Absatz 3 aufgeführten Schritte durch, sofern alle folgenden Bedingungen erfüllt sind:

- a) das Transaktionsregister hat die in Artikel 1 Absätze 1 und 2 genannten Überprüfungen abgeschlossen,
- b) beide Gegenparteien des gemeldeten Derivats unterliegen einer Meldepflicht gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012,
- c) das Transaktionsregister hat keine Meldung mit der Art des Vorgangs „Fehler“ in Bezug auf das gemeldete Derivat erhalten, es sei denn, auf diese Meldung folgte eine Meldung mit der Art des Vorgangs „Wiederherstellung“.

(2) Ein Transaktionsregister trifft Vorkehrungen, um beim Austausch von Informationen mit anderen Transaktionsregistern und bei der Bereitstellung von Informationen an meldende Gegenparteien, meldende Stellen, für Meldungen zuständige Stellen sowie Dritte, denen gemäß Artikel 78 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 Zugang zu Informationen über die Werte aller Felder, die Gegenstand des Abgleichs sind, gewährt wurde, die Vertraulichkeit der Daten sicherzustellen.

(3) Sind alle in Absatz 1 genannten Bedingungen erfüllt, führt das Transaktionsregister die folgenden Schritte durch und verwendet dabei für jedes der Felder in Tabelle 2 des Anhangs die zum vorhergehenden Arbeitstag letzten gemeldeten Werte:

- a) nach Erhalt einer Derivatemeldung überprüft das Transaktionsregister, ob es von oder im Namen der anderen Gegenpartei eine korrespondierende Meldung erhalten hat;
- b) hat das Transaktionsregister die unter Buchstabe a genannte korrespondierende Derivatemeldung nicht erhalten, versucht es zu ermitteln, bei welchem Transaktionsregister diese eingegangen ist und teilt allen registrierten Transaktionsregistern zu diesem Zweck die Werte der folgenden, im Rahmen der Derivatemeldung ausgewiesenen Felder mit: „Individuelle Transaktionskennziffer“, „Gegenpartei 1“ und „Gegenpartei 2“;
- c) stellt das Transaktionsregister fest, dass ein anderes Transaktionsregister die unter Buchstabe a genannte korrespondierende Derivatemeldung erhalten hat, so tauscht es mit diesem die Einzelheiten des gemeldeten Derivats in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema aus;

- d) ein Transaktionsregister behandelt ein gemeldetes Derivat als abgeglichen, wenn die Einzelheiten dieses Derivats, das Gegenstand des Abgleichs ist, mit den Einzelheiten des korrespondierenden Derivats gemäß Buchstabe a übereinstimmen und innerhalb der zulässigen Toleranzgrenzen und im Einklang mit den jeweiligen Anwendungszeitpunkten gemäß Tabelle 2 des Anhangs liegen;
- e) im Anschluss daran weist das Transaktionsregister bei jedem gemeldeten Derivategeschäft den in Tabelle 3 des Anhangs genannten Kategorien, in denen ein Abgleich vorgenommen wird, einen Wert zu;
- f) das Transaktionsregister schließt die unter den Buchstaben a bis e genannten Schritte frühestmöglich ab und unternimmt keinen dieser Schritte an einem Arbeitstag nach Mitternacht koordinierter Weltzeit;
- g) kann ein Transaktionsregister ein gemeldetes Derivat nicht abgleichen, so bemüht es sich, den Abgleich der Einzelheiten dieses gemeldeten Derivats am darauffolgenden Arbeitstag vorzunehmen. 30 Kalendertage, nachdem das Derivat nicht mehr aussteht, bemüht sich das Transaktionsregister nicht mehr um Abgleich für das gemeldete Derivat.

(4) Ein Transaktionsregister bestätigt am Ende jedes Arbeitstages die Gesamtzahl der aufgerechneten Derivate und die Zahl der abgeglichenen Derivate mit jedem Transaktionsregister, mit dem es Derivate abgeglichen hat. Ein Transaktionsregister verfügt über schriftliche Verfahren, mit denen sichergestellt wird, dass alle im Zuge dieses Prozesses festgestellten Diskrepanzen behoben werden.

(5) Ein Transaktionsregister übermittelt den die Meldung einreichenden Stellen spätestens sechzig Minuten nach Abschluss des in Absatz 3 Buchstabe f beschriebenen Abgleichprozesses die Ergebnisse des von ihm für die gemeldeten Derivate durchgeführten Abgleichprozesses. Diese Ergebnisse, die auch Angaben zu den nicht abgeglichenen Feldern umfassen, stellt das Transaktionsregister in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema bereit.

#### Artikel 4

#### **Tagesendstandsmitteilungen**

(1) Ein Transaktionsregister stellt den meldenden Gegenparteien, meldenden Stellen, für Meldungen zuständigen Stellen sowie Dritten, denen gemäß Artikel 78 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 Zugang zu Informationen gewährt wurde, für jeden Arbeitstag die folgenden Informationen über die betreffenden Derivate in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema zur Verfügung:

- a) die im Laufe dieses Tages gemeldeten Derivate,
- b) die jüngsten Handelsstände der ausstehenden Derivate,
- c) die im Laufe dieses Tages zurückgewiesenen Derivatemeldungen,
- d) den Stand des Abgleichs aller gemeldeten Derivate, die gemäß Artikel 3 Absatz 1 einem Abgleich unterliegen,
- e) die ausstehenden Derivate, für die keine Bewertung gemeldet wurde oder für die die gemeldete Bewertung mehr als 14 Kalendertage vor dem Tag liegt, für den die Meldung erstellt wird,
- f) die ausstehenden Derivate, für die keine Einschuss-/Nachschusszahlungen gemeldet wurden oder für die die gemeldeten Einschuss-/Nachschusszahlungen mehr als 14 Kalendertage vor dem Tag liegen, für den die Meldung erstellt wurde,
- g) die an diesem Tag erhaltenen Derivate der Art des Vorgangs „Neu“, „Positionskomponente“, „Modifikation“ oder „Korrektur“, die einen ungewöhnlichen Nennbetrag für diese Derivatekategorie aufweisen.

(2) Ein Transaktionsregister stellt diese Informationen spätestens um 6.00 Uhr koordinierter Weltzeit an dem Arbeitstag zur Verfügung, der auf den Tag folgt, auf den sich die in Absatz 1 genannten Informationen beziehen.

*Artikel 5***Inkrafttreten und Geltung**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 29. April 2024.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN

---

## ANHANG

Tabelle 1

**Gründe für die Ablehnung einer Derivatemeldung**

Kategorien für Ablehnungen	Grund
Schema	— das Derivat wurde abgelehnt, weil das Schema nicht vorschriftsmäßig ist
Berechtigung	— das Derivat wurde abgelehnt, weil die meldende Stelle nicht zur Meldung im Namen der meldenden Gegenpartei berechtigt ist
Logik	— das Derivat wurde abgelehnt, weil die für das Derivat angegebene Art des Vorgangs keinen Sinn ergibt
Geschäft	— das Derivat wurde abgelehnt, weil die Überprüfung ergeben hat, dass das Derivat in einem oder mehreren Punkten nicht den Vorgaben entspricht

Tabelle 2

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (meldende Gegenpartei)	Wie in Feld 9 dieser Tabelle	Startdatum der Meldepflicht
5	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 1	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
6	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 1	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
7	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 1	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
8	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
9	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	Wie in Feld 4 dieser Tabelle	Startdatum der Meldepflicht
10	Parteien des Derivats	Land der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
11	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
12	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
13	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
14	Parteien des Derivats	Meldepflicht der Gegenpartei 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
15	Parteien des Derivats	Makler-ID	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
16	Parteien des Derivats	Clearingmitglied	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
17	Parteien des Derivats	Richtung	Gegenläufig	Startdatum der Meldepflicht
18	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 1	Gegenläufig	Startdatum der Meldepflicht
19	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 2	Gegenläufig	Startdatum der Meldepflicht
20	Parteien des Derivats	Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
1	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI	Nein	Startdatum der Meldepflicht
2	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Laufende Meldenummer	Nein	Startdatum der Meldepflicht
3	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Vorherige UTI (für „one-to-one“- und „one-to-many“-Beziehungen zwischen Transaktionen)	Nein	Zwei Jahre nach dem Startdatum der Meldepflicht
4	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI der späteren Position	Nein	Zwei Jahre nach dem Startdatum der Meldepflicht
5	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	ID des Dienstes zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (PTRR)	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
6	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Kennung des Pakets	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
7	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN)	Nein	Startdatum der Meldepflicht
8	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Eindeutige Produktkennung (UPI)	Nein	Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
9	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Produktklassifizierung	Nein	Startdatum der Meldepflicht
10	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art des Kontrakts	Nein	Startdatum der Meldepflicht
11	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kategorie von Vermögenswerten	Nein	Startdatum der Meldepflicht
12	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Derivat auf Basis von Kryptoanlagen	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
13	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art der Identifizierung der Basiswerte	Nein	Startdatum der Meldepflicht
14	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Identifizierung der Basiswerte	Nein	Startdatum der Meldepflicht
15	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Indikator des Basisindexes	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
16	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Name des Basisindexes	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
17	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Code des kundenspezifischen Korbs	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
18	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kennung der Bestandteile des Korbs	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
19	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung 1	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
20	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung 2	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
21	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsbetrag	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
22	Abschnitt 2c – Bewertung	Währung der Bewertung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
23	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungszeitstempel	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT



	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
24	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsmethode	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
25	Abschnitt 2c – Bewertung	Delta	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
26	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
27	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
28	Abschnitt 2e – Risikominderung/ Meldung	Bestätigungszeitstempel	Ja	Startdatum der Meldepflicht
29	Abschnitt 2e – Risikominderung/ Meldung	Bestätigt	Nein	Startdatum der Meldepflicht
30	Abschnitt 2f – Clearing	Clearingpflicht	Ja	Startdatum der Meldepflicht
31	Abschnitt 2f – Clearing	Gecleart	Nein	Startdatum der Meldepflicht
32	Abschnitt 2f – Clearing	Clearing-Zeitstempel	Ja	Startdatum der Meldepflicht
33	Abschnitt 2f – Clearing	Zentrale Gegenpartei	Nein	Startdatum der Meldepflicht
34	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art der Rahmenvereinbarung	Ja	Startdatum der Meldepflicht
35	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Andere Art von Rahmenvertrag	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
36	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Fassung des Rahmenvertrags	Nein	Startdatum der Meldepflicht
37	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gruppenintern	Nein	Startdatum der Meldepflicht
38	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR	Nein	Startdatum der Meldepflicht
39	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art des PTRR-Verfahrens	Nein	Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
40	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR-Dienstleister	Nein	Startdatum der Meldepflicht
41	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Ausführungsort	Nein	Startdatum der Meldepflicht
42	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ausführungszeitstempel	Ja	Startdatum der Meldepflicht
43	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn	Nein	Startdatum der Meldepflicht
44	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ablaufdatum	Nein	Startdatum der Meldepflicht
45	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Datum der vorzeitigen Beendigung	Nein	Startdatum der Meldepflicht
46	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Endgültiges vertragliches Abwicklungsdatum	Nein	Startdatum der Meldepflicht
47	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Art der Lieferung	Nein	Startdatum der Meldepflicht
48	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis	Ja	Startdatum der Meldepflicht
49	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises	Nein	Startdatum der Meldepflicht
50	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Geltungsbeginn des Preises	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
51	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Endtermin des Preises	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
52	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltender Preis zwischen dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn und dem Endtermin	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
53	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis des Transaktionspakets	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
54	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises des Transaktionspakets	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
55	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 1	Ja	Startdatum der Meldepflicht
56	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
57	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
58	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
59	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Ja	Startdatum der Meldepflicht
60	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 1	Ja	Startdatum der Meldepflicht
61	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
62	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
63	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Ja	Startdatum der Meldepflicht
64	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 2	Ja	Startdatum der Meldepflicht
65	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
66	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
67	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
68	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ja	Startdatum der Meldepflicht
69	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 2	Ja	Startdatum der Meldepflicht
70	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
71	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
72	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ja	Startdatum der Meldepflicht
73	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Art der Zahlung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
74	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsbetrag	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
75	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Zahlungswährung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
76	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiges Datum der Zahlung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
77	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahler	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
78	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsempfänger	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
79	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz Leg 1 oder Kupon	Ja	Startdatum der Meldepflicht
80	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode Festsatz oder Kupon Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
81	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz Festsatz oder Kupon Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
82	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator für die Zahlungsfrequenz Festsatz oder Kupon Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
83	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
84	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
85	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 1	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
86	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
87	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
88	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
89	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum des variablen Zinssatzes von Leg 1 – Zeitraum	Nein	Startdatum der Meldepflicht
90	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum des variablen Zinssatzes von Leg 1 – Multiplikator	Nein	Startdatum der Meldepflicht
91	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
92	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1	Nein	Startdatum der Meldepflicht
93	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 1	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
94	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads von Leg 1	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
95	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz von Leg 2	Ja	Startdatum der Meldepflicht
96	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode Festsatz von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
97	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
98	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
99	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
100	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
101	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 2	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
102	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
103	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
104	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
105	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum des variablen Zinssatzes von Leg 2 – Zeitraum	Nein	Startdatum der Meldepflicht
106	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum des variablen Zinssatzes von Leg 2 – Multiplikator	Nein	Startdatum der Meldepflicht
107	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
108	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2	Nein	Startdatum der Meldepflicht
109	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 2	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
110	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads von Leg 2	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
111	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread des Transaktionspakets	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
112	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads des Transaktionspakets	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
113	Abschnitt 2i – Devisen	Wechselkurs 1	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
114	Abschnitt 2i – Devisen	Devisenterminkurs	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
115	Abschnitt 2i – Devisen	Umrechnungsbasis	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
116	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Basisprodukt	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
117	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Unterprodukt	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
118	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Weiteres Unterprodukt	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
119	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferpunkt oder -zone	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
120	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Kopplungspunkt	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
121	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Art der Last	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
122	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startzeitpunkt des Lieferintervalls	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
123	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endzeitpunkt des Lieferintervalls	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
124	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startdatum der Lieferung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
125	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endtermin der Lieferung	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
126	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Laufzeit	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
127	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Wochentage	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
128	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferkapazität	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht

	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
129	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Mengeneinheit	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
130	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Preis-/Zeitintervallmenge	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
131	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Währung der Preis-/Zeitintervallmenge	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
132	Abschnitt 2l – Optionen	Art der Option	Nein	Startdatum der Meldepflicht
133	Abschnitt 2l – Optionen	Optionstyp	Nein	Startdatum der Meldepflicht
134	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
135	Abschnitt 2l – Optionen	Geltungsbeginn des Ausübungspreises	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
136	Abschnitt 2l – Optionen	Endtermin des Ausübungspreises	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
137	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn gilt	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
138	Abschnitt 2l – Optionen	Währung/Währungspaar des Ausübungspreises	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
139	Abschnitt 2l – Optionen	Betrag der Optionsprämie	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
140	Abschnitt 2l – Optionen	Währung der Optionsprämie	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
141	Abschnitt 2l – Optionen	Zahlungstermin der Optionsprämie	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht



	Abschnitt	Feld	Toleranz bei der Abgleichung	Startdatum der Abgleichung
142	Abschnitt 2i – Optionen	Fälligkeitsdatum des Basiswerts	Nein	Startdatum der Meldepflicht
143	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Rang	Nein	Startdatum der Meldepflicht
144	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Referenzeinrichtung	Nein	Startdatum der Meldepflicht
145	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Serien	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
146	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Version	Nein	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
147	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Indexfaktor	Ja	Startdatum der Meldepflicht
148	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Tranche	Nein	Startdatum der Meldepflicht
149	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Attachment-Point des Kreditderivat-Swap-Index (CDS-Index)	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
150	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Detachment-Point des CDS-Index	Ja	Zwei Jahre ab dem Startdatum der Meldepflicht
151	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Vorgangs	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
152	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ereignisart	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
153	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Datum des Ereignisses	ENTFÄLLT	ENTFÄLLT
154	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ebene	Nein	Startdatum der Meldepflicht

Tabelle 3

Kategorien, in denen ein Abgleich vorgenommen wird	Zulässige Werte
Meldepflicht für beide Gegenparteien	Ja/Nein
Art der Meldung	Einseitig/zweiseitig
Koppelung	Aufgerechnet/nicht aufgerechnet
Abgleich	Abgeglichen/nicht abgeglichen
Abgleich der Bewertung	Abgeglichen/nicht abgeglichen
Wiederhergestellt	Ja/Nein
Weitere Änderungen	Ja/Nein

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2022/1859 DER KOMMISSION****vom 10. Juni 2022****zur Änderung der in der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 festgelegten technischen Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format von Anträgen auf Registrierung von Transaktionsregistern und Anträge auf Ausweitung der Registrierung von Transaktionsregistern****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 56 Absatz 4 Unterabsatz 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) In der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 der Kommission <sup>(2)</sup> ist ein einheitliches Format für Anträge auf Registrierung von Transaktionsregistern festgelegt. Für die Transaktionsregister hat sich die Verwendung des in der genannten Verordnung vorgesehenen einheitlichen Formats bei der Übermittlung von Informationen über den Antrag auf Registrierung eines Transaktionsregisters an die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde bewährt. Da die im Antrag auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister vorzulegenden Informationen den entsprechenden Informationen ähneln, die bei einem Antrag auf Registrierung als Transaktionsregister zu übermitteln sind, ist das gleiche einheitliche Format für beide Anträge geeignet.
- (2) Gemäß der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission <sup>(3)</sup> gibt das Transaktionsregister in dem Fall, dass eine Anforderung gemäß dieser Verordnung nach Auffassung des antragstellenden Transaktionsregisters auf dieses nicht anwendbar ist, in seinem Antrag klar an, um welche Anforderung es sich handelt und begründet, warum diese nicht anwendbar ist. Diese Anforderungen und Erläuterungen sollten im Antrag auf Registrierung oder Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister unmissverständlich angegeben werden. Verweise auf den delegierten Rechtsakt, die auf die technischen Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister in der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 Bezug nehmen, sollten daher durch Verweise auf die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 ersetzt werden.
- (3) Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 sollte daher entsprechend geändert werden.
- (4) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde vorgelegt wurde. Die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde hat zu dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der dieser Verordnung zugrunde liegt, öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(4)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

<sup>(2)</sup> Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format von Anträgen auf Registrierung von Transaktionsregistern gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 352 vom 21.12.2012, S. 30).

<sup>(3)</sup> Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden (ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 25).

<sup>(4)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

### Artikel 1

Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1248/2012 wird wie folgt geändert:

1. Artikel 1 erhält folgende Fassung:

„Artikel 1

#### **Format des Antrags**

(1) Anträge auf Registrierung als Transaktionsregister und Anträge auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister werden in dem im Anhang beschriebenen Format übermittelt.

(2) Das Transaktionsregister weist allen von ihm vorgelegten Unterlagen eine eindeutige Referenznummer zu und legt klar dar, auf welche spezielle, in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 (\*) festgelegte Anforderung sich die jeweilige Unterlage bezieht.

(3) Legt das Transaktionsregister keine Informationen zu einer speziellen, in der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 festgelegten Anforderung vor, so sind im Antrag auf Registrierung als Transaktionsregister bzw. gegebenenfalls im Antrag auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister die Gründe für die Nichtvorlage dieser Informationen eindeutig anzugeben.

(4) Anträge auf Registrierung als Transaktionsregister und Anträge auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister werden auf einem dauerhaften Datenträger im Sinne des Artikels 2 Absatz 1 Buchstabe m der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates (\*\*\*) gestellt.

(\*) Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden (Abl. L 52 vom 23.2.2013, S. 25).

(\*\*) Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (Abl. L 302 vom 17.11.2009, S. 32).“

2. Der Anhang wird gemäß dem Anhang der vorliegenden Verordnung geändert.

### Artikel 2

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN

## ANHANG

Der Anhang wird wie folgt geändert:

1. Die Überschrift erhält folgende Fassung:

**„FORMAT FÜR ANTRÄGE AUF REGISTRIERUNG ALS TRANSAKTIONSREGISTER UND FÜR ANTRÄGE AUF AUSWEITUNG DER REGISTRIERUNG ALS TRANSAKTIONSREGISTER“.**

2. In der zweiten Tabelle erhält die Überschrift folgende Fassung:

„VERWEISE AUF UNTERLAGEN“.

3. In der zweiten Tabelle erhält die Überschrift der ersten Spalte folgende Fassung:

„Artikel der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission“.

---

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2022/1860 DER KOMMISSION****vom 10. Juni 2022****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 9 Absatz 6 Unterabsatz 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission <sup>(2)</sup> wurde erheblich geändert. Da weitere Änderungen erforderlich wären, um die Klarheit und Kohärenz des Rechtsrahmens, einschließlich der Meldepflichten in anderen Rechtsräumen, zu verbessern, sollte die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 aufgehoben und durch die vorliegende Verordnung ersetzt werden.
- (2) Die Einzelheiten, die die Gegenparteien von Derivaten an Transaktionsregister melden, sollten in einem harmonisierten Format übermittelt werden, um die Erhebung, die Aggregation und den Vergleich von Daten zwischen den Transaktionsregistern zu erleichtern. Daher sollte das Format für jedes der zu meldenden Felder vorgeschrieben werden, und die Berichte sollten unter Bezugnahme auf eine in der Finanzbranche weithin verwendete ISO-Norm standardisiert werden.
- (3) Für ein einzelnes Derivat kann eine Reihe von Meldungen vorgelegt werden, z. B. wenn an diesem Derivat aufeinanderfolgende Änderungen vorgenommen werden. Um sicherzustellen, dass jede Meldung zu einem Derivat und jedes einzelne Derivat insgesamt richtig verstanden wird, sollten die Meldungen in der zeitlichen Abfolge, in der die gemeldeten Ereignisse eingetreten sind, erfolgen.
- (4) Zur Verringerung des Aufwands für die Meldung von Änderungen bestimmter Werte, insbesondere der Einzelheiten zur Bewertung des Kontrakts und der gemeldeten oder erhaltenen Einschusszahlungen, sollten diese Angaben nach dem jeweiligen Stand zum Tagesende gemeldet werden.
- (5) Das System der globalen Rechtsträgerkennung (LEI) wurde inzwischen vollständig eingeführt, und jede Gegenpartei eines Derivats oder eine für die Meldung zuständige Stelle sollte daher nur dieses System nutzen, um einen Rechtsträger in einer Meldung zu identifizieren. Damit das LEI-System wirksam genutzt werden kann, sollte diese Gegenpartei oder diese für die Meldung zuständige Stelle sicherstellen, dass die Referenzdaten zu ihrer LEI im Einklang mit den Bedingungen eines akkreditierten LEI-Emittenten, einer so genannten lokalen operativen Stelle, erneuert werden.
- (6) Bei bestimmten Produkten ist es kompliziert, die Gegenparteiseite eines Derivats zu bestimmen. Damit diese Informationen einheitlich und korrekt gemeldet werden, sollten daher spezifische Regeln für die Bestimmung der Richtung des Derivats festgelegt werden.
- (7) Um die tatsächlichen Risikopositionen von Gegenparteien bestimmen zu können, benötigen die zuständigen Behörden vollständige und exakte Informationen über den Austausch von Sicherheiten zwischen den Gegenparteien. Deshalb sollten spezifische Vorschriften festgelegt werden, die eine kohärente Vorgehensweise für die Meldung der Besicherung für ein bestimmtes Derivat oder Portfolio gewährleisten.

<sup>(1)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

<sup>(2)</sup> Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 352 vom 21.12.2012, S. 20).

- (8) Die genaue Spezifizierung und Klassifizierung sowie die präzise Identifizierung von Derivaten ist von zentraler Bedeutung für eine effiziente Datennutzung und eine aussagekräftige Aggregation der Daten über Transaktionsregister hinweg und trägt daher zu den Zielen bei, die der Rat für Finanzstabilität in der am 19. September 2014 veröffentlichten Durchführbarkeitsstudie über die Aggregation von Daten der Transaktionsregister für OTC-Derivate beschrieben hat. Darüber hinaus ist die Umsetzung der weltweit vereinbarten einheitlichen Produktkennung (UPI) von entscheidender Bedeutung, um die Aggregation von Derivatdaten auf globaler Ebene zu ermöglichen. Die Meldepflichten bezüglich der Klassifizierung und Identifizierung von Derivaten sollten daher so festgelegt werden, dass die betreffenden Informationen den zuständigen Behörden in vollem Umfang zur Verfügung gestellt werden.
- (9) Die rechtzeitige Generierung und Bereitstellung der eindeutigen Geschäftsabschluss-Kennziffer (UTI) <sup>(\*)</sup> ist unerlässlich, um es beiden Gegenparteien zu ermöglichen, dieselbe UTI zu verwenden und so die korrekte Identifizierung und Verknüpfung der beiden Meldungen zu demselben Derivat zu gewährleisten. Daher müssen Kriterien für die Bestimmung der für die Generierung der UTI zuständigen Stelle festgelegt werden, damit ein und dasselbe Derivat nicht doppelt gezählt wird. Um dieses Ziel auch für Derivate zu erreichen, die mit Gegenparteien außerhalb der Union geschlossen werden, ist es außerdem wichtig, diese Vorschriften an die weltweit vereinbarten Leitlinien für die UTI anzugleichen.
- (10) Eine Änderung der LEI einer bestimmten Stelle aufgrund eines Unternehmensereignisses oder der Erlangung einer LEI durch einen Rechtsträger kann dazu führen, dass eine erhebliche Anzahl von Meldungen aktualisiert werden muss, insbesondere alle Meldungen, bei denen eine solche Stelle als an einem Derivat beteiligte Partei identifiziert wird. Aus diesem Grund sollte ein Verfahren eingeführt werden, mit dem sichergestellt wird, dass die Transaktionsregister die Kennung des Unternehmens zentral aktualisieren können und damit eine effiziente, belastbare und zeitnahe Vorgehensweise besteht.
- (11) Den Behörden sind bestimmte erhebliche Meldeprobleme der beaufsichtigten meldenden Stellen möglicherweise nicht bekannt, z. B. wenn solche Probleme nicht zur Ablehnung von Meldungen oder zu Abgleichfehlern führen. Um sicherzustellen, dass die Behörden die erheblichen Meldeprobleme wahrnehmen können, sollten die für die Meldung zuständigen Stellen die zuständigen Behörden über relevante Fehler und Unterlassungen bei der Meldung unterrichten.
- (12) Trägt eine finanzielle Gegenpartei gemäß Artikel 9 Absatz 1a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 allein die Verantwortung und die gesetzliche Haftung für die Meldung der Einzelheiten von OTC-Derivatekontrakten im Namen einer nichtfinanziellen Gegenpartei, so sollte die finanzielle Gegenpartei die erforderlichen Vorkehrungen treffen, um sicherzustellen, dass sie dieser Verpflichtung ordnungsgemäß nachkommen kann, ohne dass die Einzelheiten von Derivaten doppelt gemeldet werden.
- (13) Unstimmigkeiten des Abgleichs sind ein klarer Hinweis auf mögliche Probleme bei der Qualität der gemeldeten Daten. Daher sollten die Gegenparteien, die für die Meldung zuständigen Stellen und gegebenenfalls die die Meldung einreichenden Stellen entsprechende Vorkehrungen getroffen haben, damit die Abgleichfehler behoben werden.
- (14) Um sicherzustellen, dass die Behörden ihren Aufgaben, insbesondere in Bezug auf die Finanzstabilität, wirksam nachkommen können, müssen sie ein klares und vollständiges Bild aller Derivate mit offenem Risiko haben. Nur durch eine harmonisierte Anforderung zur ordnungsgemäßen Aktualisierung aller ausstehenden Derivate lässt sich eine unterschiedliche Umsetzung der Meldepflichten für ausstehende Derivate verhindern und somit das Risiko verringern, dass die Aufsichtskonvergenz untergraben wird. Darüber hinaus ermöglicht die Vereinheitlichung der Meldungen über ausstehende Derivate in Bezug auf Dateninhalt und Datenqualität eine Vereinfachung der Meldeströme, was langfristig zu einer Kostensenkung für alle relevanten Interessenträger, einschließlich der Transaktionsregister, meldenden Stellen und Behörden, führt. Zur Verbesserung der Funktionsweise und Verringerung des Meldeaufwands im Einklang mit den Zielen der mit der Verordnung (EU) 2019/834 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(\*)</sup> eingeführten Änderungen der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ist es

<sup>(\*)</sup> Der in Artikel 9 Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 verwendete Begriff „eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer“ entspricht dem in der ISO-Norm 23897 verwendeten Begriff der eindeutigen Handelsgeschäfts-Kennung (UTI).

<sup>(\*)</sup> Verordnung (EU) 2019/834 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Mai 2019 zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 in Bezug auf die Clearingpflicht, die Aussetzung der Clearingpflicht, die Meldepflichten, die Risikominderungsstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei geclearte OTC-Derivatekontrakte, die Registrierung und Beaufsichtigung von Transaktionsregistern und die Anforderungen an Transaktionsregister (ABl. L 141 vom 28.5.2019, S. 42).

daher von wesentlicher Bedeutung, dass die Gegenparteien vollständige und genaue Einzelheiten aller ausstehenden Derivate im Einklang mit den derzeit geltenden Anforderungen melden. Um den anfänglichen Aufwand in Bezug auf die Aktualisierung ausstehender Derivate zu verringern, sollte den Gegenparteien mehr Zeit für die Aktualisierung der Daten zu den ausstehenden Derivaten eingeräumt werden. Darüber hinaus sollten die Gegenparteien eine solche Aktualisierung nur dann vorlegen müssen, wenn innerhalb dieser Frist keine Änderung eintritt, die es erforderlich machen würde, dass die Gegenpartei vollständige und genaue Angaben zu dem Derivat in einer Meldung zu dieser Änderung macht.

- (15) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (16) Vor der Vorlage des Entwurfs technischer Durchführungsstandards, der dieser Verordnung zugrunde liegt, hat die ESMA die Mitglieder des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB) konsultiert. Die ESMA hat zu dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der dieser Verordnung zugrunde liegt, öffentliche Konsultationen durchgeführt, die potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(?)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.
- (17) Damit die Gegenparteien und Transaktionsregister alle erforderlichen Maßnahmen zur Anpassung an die neuen Anforderungen ergreifen können, sollte der Geltungsbeginn dieser Verordnung um 18 Monate verschoben werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

### Datenstandards und Formate von Meldungen über Derivate

Die Einzelheiten eines gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zu meldenden Derivatekontrakts werden im Einklang mit den in den Tabellen 1, 2 und 3 des Anhangs dieser Verordnung festgelegten Standards und Formaten und in einer gemeinsamen elektronischen, maschinenlesbaren Form und in einem gemeinsamen XML-Schema nach der ISO-20022-Methodik übermittelt.

#### Artikel 2

### Häufigkeit der Meldungen

- (1) Alle Meldungen der in Artikel 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission <sup>(6)</sup> genannten Einzelheiten eines Derivats sind in der zeitlichen Reihenfolge zu übermitteln, in der die Ereignisse, die sich auf die zu meldenden Informationen beziehen, eingetreten sind.
- (2) Eine CCP, eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, die eine Gegenpartei eines Derivats ist, oder die für die Meldung zuständige Stelle meldet jede Änderung der Angaben zu den Sicherheiten in den Feldern 1 bis 29 Tabelle 3 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 mit der Art des Vorgangs „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen“ so, wie sie am Ende eines jeden Tages für das betreffende Derivat vorliegen, wenn:
  - a) das Derivat nicht fällig ist und nicht Gegenstand einer Meldung mit der Art des Vorgangs „Beendigung“, „Fehler“ oder „Positionskomponente“ gemäß Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs war oder
  - b) das Derivat Gegenstand einer Meldung mit der Art des Vorgangs „Wiederherstellung“ war, auf die keine weitere Meldung mit der Art des Vorgangs „Beendigung“ oder „Fehler“ gemäß Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs folgte.

<sup>(?)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(6)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates bezüglich technischer Regulierungsstandards, in denen die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister und die Art der zu verwendenden Meldungen festgelegt werden (siehe Seite 1 dieses Amtsblatts).



(3) Eine Gegenpartei eines in Absatz 2 Buchstaben a und b genannten Derivats, die eine CCP, eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ist, oder die für die Meldung zuständige Stelle meldet in den Feldern 21 bis 25 der Tabelle 2 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 mit der Art des Vorgangs „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen“ die Tagesendbewertung des Kontrakts zu Marktpreisen oder zu Modellpreisen so, wie sie am Ende eines jeden Tages vorliegt.

### Artikel 3

#### Identifizierung von Gegenparteien und anderen Stellen

(1) Bei einer Meldung ist eine Rechtsträgerkennung nach ISO 17442 (LEI-Code) zu verwenden, um Folgendes zu identifizieren:

- a) eine Maklerfirma,
- b) eine zentrale Gegenpartei,
- c) ein Clearingmitglied,
- d) eine Gegenpartei, bei der es sich um juristische Personen handelt,
- e) eine die Meldung einreichende Stelle,
- f) eine für die Meldung zuständige Stelle,
- g) einen Anbieter von Diensten zur Verringerung von Nachhandelsrisiken.

(2) Eine Gegenpartei 1 eines Derivats gemäß Feld 4 der Tabelle 1 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 und die für die Meldung zuständige Stelle stellen sicher, dass die Referenzdaten in Bezug auf ihren ISO 17442 LEI-Code gemäß den Bedingungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems bei der Meldung des Abschlusses oder der Änderung eines Derivatekontrakts gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erneuert werden.

### Artikel 4

#### Richtung des Derivats

(1) Die in Tabelle 1 Feld 17 bis 19 des Anhangs genannte Seite der Gegenpartei eines Derivatekontrakts wird zum Zeitpunkt des Abschlusses des Derivats gemäß den Absätzen 2 bis 14 bestimmt.

(2) Bei Optionen und Swaptions wird die Gegenpartei, die das Recht auf Ausübung der Option innehat, als Käufer und die Gegenpartei, die die Option gegen eine Prämie verkauft, als Verkäufer angegeben.

(3) Bei außerbörslichen Finanzterminkontrakten, die sich auf Währungen beziehen, wird die Gegenpartei 1 entweder als Zahler oder Empfänger bei „Leg 1“ und das jeweilige Gegenteil bei „Leg 2“ angegeben. Die Gegenpartei 2 füllt die Felder 18 und 19 der Tabelle 1 mit den gegenteiligen Werten zur Gegenpartei 1 aus.

(4) Bei Swaps, die sich auf Währungen beziehen, bei denen mehrere Währungsumtauschvorgänge stattfinden, wird jeder Gegenpartei für beide „Legs“ der Transaktion entweder als Zahler oder Empfänger des „Legs“ auf der Grundlage des Währungsumtauschs identifiziert, der dem Fälligkeitstag am nächsten liegt.

(5) Bei außerbörslichen Finanzterminkontrakten mit Ausnahme von Devisentermingeschäften und bei börsengehandelten Finanzterminkontrakten wird die Gegenpartei, die das Instrument kauft, als Käufer und die Gegenpartei, die das Instrument verkauft, als Verkäufer angegeben.

(6) Bei finanziellen Differenzkontrakten und Spreadbets wird die Gegenpartei, die bei dem Kontrakt Leerverkäufe tätigt, als Verkäufer und die Gegenpartei, die bei dem Kontrakt Kaufgeschäfte tätigt, als Käufer angegeben.

(7) Bei Swaps, die sich auf Dividenden beziehen, wird die Gegenpartei, die die äquivalenten Dividendenzahlungen erhält, als Käufer und die Gegenpartei, die die äquivalenten Dividendenzahlungen leistet, als Verkäufer angegeben.

(8) Bei Swaps, die sich auf Wertpapiere beziehen, mit Ausnahme von auf Dividenden bezogenen Swaps wird die Gegenpartei 1 entweder als Zahler oder Empfänger bei „Leg 1“ und das jeweilige Gegenteil bei „Leg 2“ angegeben. Die Gegenpartei 2 füllt die Felder 18 und 19 der Tabelle 1 mit den gegenteiligen Werten zur Gegenpartei 1 aus.

(9) Bei Swaps, die sich auf Zinssätze oder Inflationsindizes beziehen, einschließlich der Währungsswaps, wird die Gegenpartei 1 entweder als Zahler oder Empfänger bei „Leg 1“ und das jeweilige Gegenteil bei „Leg 2“ angegeben. Die Gegenpartei 2 füllt die Felder 18 und 19 der Tabelle 1 mit den gegenteiligen Werten zur Gegenpartei 1 aus.

(10) Bei derivativen Instrumenten zur Übertragung des Kreditrisikos mit Ausnahme von Optionen und Swaptions wird die Gegenpartei, die die Absicherung kauft, als Käufer und die Gegenpartei, die die Absicherung verkauft, als Verkäufer angegeben.

(11) Bei Swaps, die sich auf Rohstoffe beziehen, wird die Gegenpartei 1 entweder als Zahler oder Empfänger bei „Leg 1“ und das jeweilige Gegenteil bei „Leg 2“ angegeben. Die Gegenpartei 2 füllt die Felder 18 und 19 der Tabelle 1 mit den gegenteiligen Werten zur Gegenpartei 1 aus.

(12) Bei Zinstermingeschäften wird die Gegenpartei 1 entweder als Zahler oder Empfänger bei „Leg 1“ und das jeweilige Gegenteil bei „Leg 2“ angegeben. Die Gegenpartei 2 füllt die Felder 18 und 19 der Tabelle 1 mit den gegenteiligen Werten zur Gegenpartei 1 aus.

(13) Bei Derivaten, die sich auf Varianz, Volatilität und Korrelation beziehen, wird die Gegenpartei, die von einem Anstieg des Preises des Basiswerts profitiert, als Käufer und die Gegenpartei, die von einem Rückgang des Preises des Basiswerts profitiert, als Verkäufer angegeben.

#### Artikel 5

### Besicherung

Die meldende Gegenpartei gibt die Art der Besicherung des Derivatekontrakts oder eines Derivateportfolios gemäß Feld 11 der Tabelle 3 des Anhangs wie folgt an:

- a) als „unbesichert“, wenn die Gegenparteien keine Sicherungsvereinbarung geschlossen haben oder in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die Gegenparteien in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio weder den Ersteinschuss noch den Nachschuss hinterlegen.
- b) als „teilbesichert: nur Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei nur regelmäßig Nachschusszahlungen leistet und dass die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;
- c) als „teilbesichert: nur Gegenpartei 2“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die andere Gegenpartei nur regelmäßig Nachschüsse leistet und dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;
- d) als „teilweise besichert“, wenn in der Sicherungsvereinbarung zwischen den Gegenparteien festgelegt ist, dass beide Gegenparteien nur regelmäßig Nachschüsse in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio leisten;
- e) als „einseitig besichert: nur Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;
- f) als „einseitig besichert: nur Gegenpartei 2“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die andere Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;
- g) als „einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio regelmäßig nur Nachschusszahlungen leistet;

- h) als „einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 2“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die andere Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio regelmäßig nur Nachschusszahlungen leistet;
- i) als „vollständig besichert“, wenn in der Sicherungsvereinbarung zwischen den Gegenparteien festgelegt ist, dass beide Gegenparteien in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio Einschusszahlungen und regelmäßige Nachschusszahlungen leisten.

#### Artikel 6

### Spezifizierung, Identifizierung und Klassifizierung von Derivaten

(1) In einer Meldung werden Angaben zu einem Derivat auf der Grundlage des Kontrakttyps und der Kategorie von Vermögenswerten gemäß den Feldern 10 und 11 der Tabelle 2 des Anhangs gemacht.

Wenn die Derivate nicht zu einer der in Feld 11 der Tabelle 2 des Anhangs genannten Derivateklassen gehören, ist in der Meldung die dem Derivat am nächsten kommende Kategorie von Vermögenswerten anzugeben. Beide Gegenparteien geben die gleiche Kategorie von Vermögenswerten an.

(2) Ein Derivat wird in Feld 7 der Tabelle 2 des Anhangs mit einer internationalen Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN) nach ISO 6166 gekennzeichnet, wenn einer der folgenden Fälle vorliegt:

- a) es ist zum Handel zugelassen oder wird an einem Handelsplatz gehandelt;
- b) es wird über einen systematischen Internalisierer gehandelt und sein Basiswert ist zum Handel zugelassen oder wird an einem Handelsplatz gehandelt bzw. ist ein Index oder Korb, der aus Instrumenten besteht, die an einem Handelsplatz gehandelt werden.

(3) Andere Derivate als die in Absatz 2 genannten werden in Feld 8 der Tabelle 2 des Anhangs unter Verwendung einer eindeutigen Produktkennung (UPI) nach ISO 4914 angegeben.

(4) Die meldende Gegenpartei stuft das Derivat in Feld 9 der Tabelle 2 des Anhangs anhand der ISO-10962-Kennziffer zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten (CFI) ein.

#### Artikel 7

### Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer

(1) Die Gegenparteien melden Derivate unter Verwendung der gemäß den Absätzen 2, 3 und 5 generierten UTI.

(2) Ein Derivat, das entweder auf Transaktions- oder Positionsebene gemeldet wird, ist anhand einer eindeutigen Handelsgeschäfts-Kennung (UTI) nach ISO 23897 in Feld 1 der Tabelle 2 des Anhangs anzugeben. Die UTI setzt sich aus der LEI der Stelle zusammen, von der diese UTI generiert wurde, gefolgt von einem auf Ebene der generierenden Stelle individuellen Code mit bis zu 32 Zeichen.

(3) Die Gegenparteien bestimmen die Stelle, die für die Generierung der UTI verantwortlich ist, wie folgt:

- a) bei geclearten Derivaten, bei denen es sich nicht um Derivate zwischen zwei CCPs handelt, wird die UTI beim Clearing durch die CCP für das Clearingmitglied generiert. Bei einer Transaktion, bei dem die CCP keine Gegenpartei ist, generiert das Clearingmitglied für seine Gegenpartei eine andere UTI;
- b) bei zentral ausgeführten, aber nicht zentral geclearten Derivaten wird die UTI vom Ausführungsplatz für sein Mitglied generiert;
- c) bei anderen als den unter den Buchstaben a und b genannten Derivaten, bei denen eine der Gegenparteien den Meldepflichten in einem Drittland unterliegt, wird die UTI gemäß den Vorschriften des Rechtsraums der Gegenpartei generiert, die diesen Meldepflichten zuerst nachkommen muss.

In Fällen, in denen die gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 meldepflichtige Gegenpartei den Meldepflichten zuerst nachkommen muss, ist die für die Erstellung der UTI zuständige Stelle:

- i) für Derivate, die auf elektronischem Wege zentral bestätigt wurden, die Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung;
- ii) bei allen anderen Derivaten einigen sich die Gegenparteien auf eine für die Generierung der UTI zuständige Stelle. Können die Gegenparteien keine Einigung erzielen, so ist diejenige Gegenpartei für die Generierung verantwortlich, deren LEI als erste auf der Sortierung der Kennungen der Gegenparteien in umgekehrter Folge der Zeichen der Kennung beruht.

Sehen die anwendbaren Rechtsvorschriften des betreffenden Drittlands dieselbe Meldefrist vor, die für die gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 meldepflichtige Gegenpartei gemäß Artikel 9 Absatz 1 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 gilt, so einigen sich die Gegenparteien auf die für die Generierung der UTI zuständige Stelle.

Können die Gegenparteien keine Einigung erzielen und wurde das Derivat auf elektronischem Wege zentral bestätigt, wird die UTI von der Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung generiert.

Kann die UTI nicht von der Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung generiert werden und müssen die Einzelheiten des Derivats an ein einziges Transaktionsregister gemeldet werden, so ist dieses Transaktionsregister für die Generierung der UTI verantwortlich.

Kann die UTI nicht von dem Transaktionsregister generiert werden, an das die Einzelheiten des Derivats gemeldet wurden, so ist die Gegenpartei, deren LEI bei der Sortierung der Kennungen der Gegenparteien in umgekehrter Folge der Zeichen an erster Stelle steht, für die Generierung verantwortlich;

- d) bei anderen als den unter den Buchstaben a, b und c genannten Derivaten, die auf elektronischem Wege zentral bestätigt wurden, wird die UTI von der Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung generiert;
- e) für alle nicht unter den Buchstaben a bis d genannten Derivate gilt Folgendes:
  - i) schließen finanzielle Gegenparteien ein Derivat mit nichtfinanziellen Gegenparteien ab, wird die UTI von der finanziellen Gegenpartei generiert;
  - ii) bei Derivaten, die zwischen nichtfinanziellen Gegenparteien oberhalb der Clearingschwelle und nichtfinanziellen Gegenparteien unterhalb der Clearingschwelle geschlossen werden, wird die UTI durch die nichtfinanziellen Gegenparteien oberhalb der Clearingschwelle generiert;
  - iii) bei allen anderen Derivaten als den unter den Ziffern i und ii genannten vereinbaren die Gegenparteien die für die Generierung der UTI zuständige Stelle. Können die Gegenparteien keine Einigung erzielen, so ist diejenige Gegenpartei für die Generierung verantwortlich, deren LEI als erste auf der Sortierung der Kennungen der Gegenparteien in umgekehrter Folge der Zeichen der Kennung beruht.

(4) Die Gegenpartei, die die UTI generiert, teilt die UTI der anderen Gegenpartei rechtzeitig, spätestens jedoch bis 10.00 Uhr koordinierte Weltzeit des auf den Abschluss des Derivats folgenden Arbeitstags mit.

(5) Ungeachtet des Absatzes 3 kann die Generierung der UTI an eine andere Stelle als die gemäß Absatz 3 bestimmte Stelle delegiert werden. Die Stelle, die die UTI generiert, muss die in den Absätzen 2 und 4 genannten Anforderungen erfüllen.

#### Artikel 8

#### **Meldung von LEI-Änderungen und Aktualisierung des Identifizierungscodes von LEI**

(1) Wird die gemäß Artikel 3 in einer Derivatemeldung genannte Gegenpartei einer Unternehmensumstrukturierung unterzogen, die zu einer Änderung ihrer LEI führt, so unterrichtet diese Gegenpartei oder die Gegenpartei, zu der die neue LEI gehört, oder die Stelle, die für die Meldung im Namen einer dieser Gegenparteien gemäß Artikel 9 Absätze 1a bis 1d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zuständig ist, oder die Stelle, an die eine der Gegenparteien die Meldung gemäß Artikel 9 Absatz 1f der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 delegiert hat, das Transaktionsregister, dem die von der

Unternehmensumstrukturierung betroffene Gegenpartei ihre Derivate gemeldet hat, über die Änderung und beantragt eine Aktualisierung der LEI in den betroffenen Derivaten gemäß Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b zum Zeitpunkt des Unternehmensumstrukturierungsereignisses, das zu einer Änderung der LEI oder der nach diesem Datum gemeldeten Kontrakte geführt hat.

(2) Nach Möglichkeit muss der Antrag auf Aktualisierung der Kennung für die Derivate gemäß Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b mindestens 30 Kalendertage vor dem Ereignis der Unternehmensumstrukturierung, das zu einer Änderung der LEI führt, gestellt werden. Kann die in Absatz 1 genannte Stelle dem Transaktionsregister diese Informationen 30 Kalendertage vor dem Ereignis der Unternehmensumstrukturierung, das zu einer Änderung der LEI geführt hat, nicht übermitteln, so informiert sie das Transaktionsregister so bald wie möglich.

(3) Der in Absatz 1 genannte Antrag umfasst mindestens die folgenden Aspekte:

- a) die LEI jeder der an der Unternehmensumstrukturierung beteiligten Gegenparteien;
- b) die LEI der neuen Gegenpartei;
- c) das Datum, an dem die Änderung der LEI erfolgt oder erfolgt ist;
- d) die UTI der betroffenen Derivate, wenn das Ereignis der Unternehmensumstrukturierung nur eine Untergruppe der in Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b genannten Derivate betrifft;
- e) einen Nachweis, dass die Unternehmensumstrukturierung stattgefunden hat oder stattfinden soll, vorbehaltlich der Offenlegungsvorschriften für die Veröffentlichung von Insiderinformationen nach Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014.

(4) Informiert eine Gegenpartei ein Transaktionsregister versehentlich über eine Änderung ihrer LEI, so folgt sie dem Verfahren zur Beantragung einer Aktualisierung ihrer LEI gemäß den Absätzen 1, 2 und 3.

(5) Wenn eine Gegenpartei, die zuvor mit einer anderen Kennung als der LEI angegeben wurde, eine LEI erhält, gelten die Verfahren der Absätze 1, 2 und 3.

(6) Betrifft eine Änderung der LEI eine in einem Drittland niedergelassene Gegenpartei, so leitet ihre meldende Gegenpartei mit Sitz in der Union oder die für die Meldung gemäß Artikel 9 Absätze 1a bis 1d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zuständige Stelle oder die Stelle, an die die meldende Gegenpartei mit Sitz in der Union die Meldung delegiert hat, das Verfahren gemäß den Absätzen 1, 2 und 3 ein.

(7) Erhält eine in einem Drittland niedergelassene Gegenpartei, die zuvor mit einer anderen Kennung als der LEI angegeben wurde, eine LEI, so fordert jede von dieser Änderung betroffene meldende Gegenpartei mit Sitz in der Union bzw. die für die Meldung gemäß Artikel 9 Absätze 1a bis 1d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zuständige Stelle oder die Stelle, an die die meldende Gegenpartei mit Sitz in der Union die Meldung delegiert hat, die Aktualisierung der Kennung der in einem Drittland niedergelassenen Gegenpartei bei ihrem jeweiligen Transaktionsregister an.

(8) Betrifft die Änderung der LEI eines der in Artikel 3 Absatz 1 Buchstaben a, b, c, e oder g genannten Unternehmen, das keine Gegenpartei des Derivats ist, so bestätigt die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung zuständige Stelle dem Transaktionsregister die UTI der in Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b genannten betroffenen Derivate. Erfolgt über die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung zuständige Stelle keine Bestätigung der UTI der in Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b genannten betroffenen Derivate an das Transaktionsregister, so aktualisiert die Gegenpartei 1 oder die für die Meldung zuständige Stelle die LEI des betroffenen Unternehmens in allen Meldungen zu den in Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b genannten betroffenen Derivaten, indem sie eine Meldung mit Art des Vorgangs „Änderung“ übermittelt.

## Artikel 9

### Methoden und Modalitäten für die Meldung

(1) Die für die Meldung zuständige Stelle unterrichtet ihre zuständige Behörde und die für die meldende Gegenpartei zuständige Behörde, falls es sich dabei um eine andere Behörde handelt, über einen der folgenden Fälle:

- a) Falschmeldungen aufgrund von Mängeln in den Meldesystemen, die sich auf eine erhebliche Anzahl von Meldungen auswirken würden,

- b) jegliche Meldehindernisse, die die meldende Stelle davon abhalten, Meldungen innerhalb der in Artikel 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Frist an ein Transaktionsregister zu übermitteln,
- c) alle wesentlichen Probleme, die zu Meldefehlern führen, die keine Ablehnung durch ein Transaktionsregister gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission <sup>(7)</sup> zur Folge haben würden.

Die für die Meldung zuständige Stelle teilt diese Fälle unverzüglich mit, sobald sie von ihnen Kenntnis erhält.

In der Meldung sind mindestens die Art des Fehlers oder der Auslassung, das Datum des Ereignisses, das Ausmaß der betroffenen Meldungen, die Gründe für die Fehler oder Auslassungen, die zur Behebung des Problems unternommenen Schritte sowie der Zeitplan für die Lösung des Problems und die Korrekturen anzugeben.

(2) Ist eine finanzielle Gegenpartei gemäß Artikel 9 Absatz 1a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 allein für die Meldung der Einzelheiten von OTC-Derivatekontrakten im Namen einer nichtfinanziellen Gegenpartei verantwortlich und rechtlich haftbar, so sollte sie die folgenden Vorkehrungen treffen:

- a) Vorkehrungen für die rechtzeitige Bereitstellung der folgenden Einzelheiten zu den OTC-Derivatekontrakten durch die nichtfinanzielle Gegenpartei, bei denen nicht davon ausgegangen werden kann, dass die finanzielle Gegenpartei über sie verfügt, und bei denen diese der finanziellen Gegenpartei unbekannt sind:
  - i) Makler-ID gemäß Feld 15 der Tabelle 1 des Anhangs,
  - ii) Clearingmitglied gemäß Feld 16 der Tabelle 1 des Anhangs,
  - iii) direkt in Verbindung mit ihrer Geschäftstätigkeit oder der Unternehmensfinanzierung gemäß Feld 20 der Tabelle 1 des Anhangs,
- b) Vorkehrungen für die rechtzeitige Information der finanziellen Gegenpartei durch die nichtfinanzielle Gegenpartei über jede Änderung ihrer rechtlichen Verpflichtungen gemäß Artikel 10 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012,
- c) Vorkehrungen für eine ordnungsgemäße Erneuerung ihrer LEI durch die nichtfinanzielle Gegenpartei im Einklang mit den Bedingungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stelle des globalen LEI-Systems,
- d) Vorkehrungen, nach denen die nichtfinanzielle Gegenpartei der finanziellen Gegenpartei rechtzeitig ihre Entscheidung mitteilt, mit der Meldung der Einzelheiten der mit der finanziellen Gegenpartei geschlossenen OTC-Derivatekontrakte zu beginnen oder diese zu nicht mehr durchzuführen. Diese Vorkehrungen sollen zumindest sicherstellen, dass die Meldung schriftlich oder in gleichwertiger Form auf elektronischem Wege mindestens zehn Arbeitstage vor dem Datum erfolgt, an dem die nichtfinanzielle Gegenpartei die Meldung beginnen oder einstellen möchte.

(3) Die Gegenparteien, die für die Meldung verantwortlichen Stellen und die die Meldung einreichenden Stellen treffen gegebenenfalls Vorkehrungen, um sicherzustellen, dass die gemäß Artikel 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 übermittelten Rückmeldungen zu den Abgleichfehlern berücksichtigt werden.

#### Artikel 10

##### **Zeitpunkt, bis zu dem Derivatekontrakte gemeldet werden müssen**

Eine Gegenpartei eines Derivats, das die in Artikel 2 Absatz 2 Buchstabe a oder b genannten Bedingungen am XX. XXX.20XX erfüllt, oder die für die Meldung zuständige Stelle meldet alle gemäß dem Anhang erforderlichen Einzelheiten dieses Derivats, indem sie innerhalb von 180 Kalendertagen nach dem [Amt für Veröffentlichungen: Bitte Datum der Anwendung der technischen Durchführungsstandards einfügen] eine Meldung mit der Ereignisart „Aktualisierung“ übermittelt, es sei denn, sie hat innerhalb dieses Zeitraums eine Meldung mit Art des Vorgangs „Änderung“ oder „Korrektur“ für dieses Derivat vorgelegt.

<sup>(7)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission vom 10. Juni 2022 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Verfahren für den Datenabgleich zwischen Transaktionsregistern und die vom Transaktionsregister anzuwendenden Verfahren zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflichten durch die meldende Gegenpartei oder die einreichende Stelle sowie zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der gemeldeten Daten festgelegt werden (siehe Seite 46 dieses Amtsblatts).

*Artikel 11***Aufhebung**

Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 wird aufgehoben.

Bezugnahmen auf die aufgehobene Verordnung gelten als Bezugnahmen auf die vorliegende Verordnung.

*Artikel 12***Inkrafttreten und Geltung**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem am 29. April 2022.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 10. Juni 2022

*Für die Kommission*  
*Die Präsidentin*  
Ursula VON DER LEYEN

---

## ANHANG

Tabelle 1

	Abschnitt	Feld	Format
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format (koordinierte Weltzeit) JJJJ-MM-TTTh:mm:ssZ
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (Meldende Gegenpartei)	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.
5	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 1	F = finanzielle Gegenpartei N = nichtfinanzielle Gegenpartei C = zentrale Gegenpartei O = Sonstige
6	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 1	Taxonomie für finanzielle Gegenparteien: „INVF“ – eine gemäß der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(1)</sup> zugelassene Wertpapierfirma; „CDTI“ – ein gemäß der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(2)</sup> zugelassenes Kreditinstitut; „INUN“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(3)</sup> zugelassenes Versicherungsunternehmen oder Rückversicherungsunternehmen; „UCIT“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(4)</sup> zugelassener OGAW und gegebenenfalls dessen Verwaltungsgesellschaft, es sei denn, der OGAW wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet; „ORPI“ – eine Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung (EbAV) im Sinne des Artikels 6 Nummer 1 der Richtlinie (EU) 2016/2341 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(5)</sup> ;



	Abschnitt	Feld	Format
			<p>„AIFD“ – ein alternativer Investmentfonds (AIF) im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(6)</sup>, der entweder in der Union niedergelassen ist oder von einem gemäß der Richtlinie 2011/61/EU zugelassenen oder eingetragenen Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird, – es sei denn, der AIF wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet oder der AIF ist eine Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne des Artikels 2 Absatz 3 Buchstabe g der Richtlinie 2011/61/EU – sowie gegebenenfalls dessen in der Union niedergelassener AIFM;</p> <p>„CSDS“ – ein gemäß der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(7)</sup> zugelassener Zentralverwahrer;</p> <p>Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien.</p> <p>Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der NACE-Systematik gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(8)</sup>:</p> <p>„A“ = Land- und Forstwirtschaft, Fischerei  „B“ = Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden  „C“ = Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren  „D“ = Energieversorgung  „E“ = Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen  „F“ = Baugewerbe/Bau  „G“ = Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen  „H“ = Verkehr und Lagerei  „I“ = Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie  „J“ = Information und Kommunikation  „K“ = Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen  „L“ = Grundstücks- und Wohnungswesen  „M“ = Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen  „N“ = Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen  „O“ = Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung  „P“ = Erziehung und Unterricht  „Q“ = Gesundheits- und Sozialwesen  „R“ = Kunst, Unterhaltung und Erholung  „S“ = Erbringung von sonstigen Dienstleistungen</p>

	Abschnitt	Feld	Format
			<p>„T“ = Private Haushalte mit Hauspersonal; Herstellung von Waren und Erbringung von Dienstleistungen durch private Haushalte für den Eigenbedarf ohne ausgeprägten Schwerpunkt</p> <p>„U“ = Exterritoriale Organisationen und Körperschaften</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, sind die Codes in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der betreffenden Tätigkeiten aufzuführen.</p> <p>Im Falle von CCPs und anderen Gegenparteien im Sinne des Artikels 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (*) bleibt dieses Feld frei.</p>
7	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 1	<p>Boolescher Wert:</p> <p>TRUE = darüber</p> <p>FALSE = darunter</p>
8	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	<p>Boolescher Wert:</p> <p>— TRUE</p> <p>— FALSE für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und die gemäß der Erklärung des Ausschusses für die Regulierungsaufsicht über Personen, die in einer Unternehmereigenschaft handeln, vom 20. September 2015 (im Folgenden „ROC-Erklärung“) keine LEI für sich beanspruchen können.</p>
9	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	<p>— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.</p> <p>Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.</p>
10	Parteien des Derivats	Land der Gegenpartei 2	Ländercode nach ISO 3166 – Ländercode aus zwei Buchstaben
11	Parteien des Derivats	Art der Gegenpartei 2	<p>F = finanzielle Gegenpartei</p> <p>N = nichtfinanzielle Gegenpartei</p> <p>C = zentrale Gegenpartei</p> <p>O = Sonstige</p>

	Abschnitt	Feld	Format
12	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 2	<p>Taxonomie für finanzielle Gegenparteien:</p> <p>„INVF“ – eine gemäß der Richtlinie 2014/65/EU zugelassene Wertpapierfirma</p> <p>„CDTI“ – ein gemäß der Richtlinie 2013/36/EU zugelassenes Kreditinstitut</p> <p>„INUN“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/138/EG zugelassenes Versicherungsunternehmen oder Rückversicherungsunternehmen</p> <p>„UCIT“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/65/EG zugelassener OGAW und gegebenenfalls dessen Verwaltungsgesellschaft, es sei denn, der OGAW wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet</p> <p>„ORPI“ – eine Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung (EbAV) im Sinne des Artikels 6 Nummer 1 der Richtlinie (EU) 2016/2341</p> <p>„AIFD“ – ein alternativer Investmentfonds (AIF) im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2011/61/EU, der entweder in der Union niedergelassen ist oder von einem gemäß dieser Richtlinie zugelassenen oder eingetragenen Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird, – es sei denn, der AIF wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet oder der AIF ist eine Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne des Artikels 2 Absatz 3 Buchstabe g der Richtlinie 2011/61/EU – sowie gegebenenfalls dessen in der Union niedergelassener AIFM</p> <p>„CSDS“ – ein gemäß der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 zugelassener Zentralverwahrer</p> <p>Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien.</p> <p>Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der NACE-Systematik gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006:</p> <p>„A“ = Land- und Forstwirtschaft, Fischerei</p> <p>„B“ = Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden</p> <p>„C“ = Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren</p> <p>„D“ = Energieversorgung</p> <p>„E“ = Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen</p> <p>„F“ = Baugewerbe/Bau</p> <p>„G“ = Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen</p> <p>„H“ = Verkehr und Lagerei</p> <p>„I“ = Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie</p> <p>„J“ = Information und Kommunikation</p> <p>„K“ = Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen</p>

	Abschnitt	Feld	Format
			<p>„L“ = Grundstücks- und Wohnungswesen</p> <p>„M“ = Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen</p> <p>„N“ = Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen</p> <p>„O“ = Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung</p> <p>„P“ = Erziehung und Unterricht</p> <p>„Q“ = Gesundheits- und Sozialwesen</p> <p>„R“ = Kunst, Unterhaltung und Erholung</p> <p>„S“ = Erbringung von sonstigen Dienstleistungen</p> <p>„T“ = Private Haushalte mit Hauspersonal; Herstellung von Waren und Erbringung von Dienstleistungen durch private Haushalte für den Eigenbedarf ohne ausgeprägten Schwerpunkt</p> <p>„U“ = Exterritoriale Organisationen und Körperschaften</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, sind die Codes in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der betreffenden Tätigkeiten aufzuführen.</p> <p>Im Falle von CCPs und anderen Gegenparteien im Sinne des Artikels 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bleibt dieses Feld frei.</p>
13	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 2	<p>Boolescher Wert:</p> <p>TRUE = darüber</p> <p>FALSE = darunter</p>
14	Parteien des Derivats	Meldepflicht der Gegenpartei 2	<p>Boolescher Wert:</p> <p>— TRUE, wenn die Meldepflicht bei der Gegenpartei 2 liegt</p> <p>— FALSE, wenn die Meldepflicht nicht bei der Gegenpartei 2 liegt</p>
15	Parteien des Derivats	Makler-ID	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
16	Parteien des Derivats	Clearingmitglied	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
17	Parteien des Derivats	Richtung	<p>Vier Buchstaben:</p> <p>BYER = Käufer</p> <p>SLLR = Verkäufer</p> <p>Gemäß Artikel 4 der vorliegenden Verordnung einzutragen.</p>

	Abschnitt	Feld	Format
18	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 1	Vier Buchstaben: MAKE = Zahler TAKE = Empfänger Gemäß Artikel 4 der vorliegenden Verordnung einzutragen.
19	Parteien des Derivats	Richtung von Leg 2	Vier Buchstaben: MAKE = Zahler TAKE = Empfänger Gemäß Artikel 4 der vorliegenden Verordnung einzutragen.
20	Parteien des Derivats	Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement	Boolescher Wert: TRUE = Ja FALSE = Nein

- (<sup>1</sup>) Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).
- (<sup>2</sup>) Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Zugang zur Tätigkeit von Kreditinstituten und die Beaufsichtigung von Kreditinstituten und Wertpapierfirmen, zur Änderung der Richtlinie 2002/87/EG und zur Aufhebung der Richtlinien 2006/48/EG und 2006/49/EG (ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 338).
- (<sup>3</sup>) Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2009 betreffend die Aufnahme und Ausübung der Versicherungs- und der Rückversicherungstätigkeit (Solvabilität II) (ABl. L 335 vom 17.12.2009, S. 1).
- (<sup>4</sup>) Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (ABl. L 302 vom 17.11.2009, S. 32).
- (<sup>5</sup>) Richtlinie (EU) 2016/2341 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Dezember 2016 über die Tätigkeiten und die Beaufsichtigung von Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung (EbAV) (ABl. L 354 vom 23.12.2016, S. 37).
- (<sup>6</sup>) Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2011 über die Verwalter alternativer Investmentfonds und zur Änderung der Richtlinien 2003/41/EG und 2009/65/EG und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 1095/2010 (ABl. L 174 vom 1.7.2011, S. 1).
- (<sup>7</sup>) Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer sowie zur Änderung der Richtlinien 98/26/EG und 2014/65/EU und der Verordnung (EU) Nr. 236/2012 (ABl. L 257 vom 28.8.2014, S. 1).
- (<sup>8</sup>) Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Dezember 2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 des Rates sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik (ABl. L 393 vom 30.12.2006, S. 1).
- (<sup>9</sup>) Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

Tabelle 2

	Abschnitt	Feld	Format
1	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI	UTI nach ISO 23897 Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
2	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Laufende Meldenummer	Alphanumerisches Feld mit bis zu 52 Zeichen

	Abschnitt	Feld	Format
3	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Vorherige UTI (für „one-to-one“- und „one-to-many“-Beziehungen zwischen Transaktionen)	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
4	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI der späteren Position	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
5	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	ID des Dienstes zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (PTRR)	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind. Die ersten 20 Zeichen stellen die LEI des Komprimierungsanbieters dar.
6	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Kennung des Pakets	Bis zu 35 alphanumerische Zeichen.
7	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN)	ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code
8	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Eindeutige Produktkennung (UPI)	UPI nach ISO 4914, 12-stelliger alphanumerischer Code
9	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Produktklassifizierung	CFI nach ISO 10962, 6-stelliger alphabetischer Code
10	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art des Kontrakts	CFDS = finanzieller Differenzkontrakt FRAS = Zinstermingeschäft FUTR = Börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future) FORW= Außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward) OPTN = Option SPDB = Spreadbet SWAP = Swap SWPT = Tauschoption (Swaption) OTHR = Sonstige
11	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kategorie von Vermögenswerten	COMM = Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten CRDT = Kreditderivat CURR = Währungsderivat EQUI = Aktienderivat INTR = Zinsderivat
12	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Derivat auf Basis von Kryptoanlagen	Boolescher Wert: — TRUE – für Derivate auf Basis von Kryptoanlagen — FALSE – für andere Derivate

	Abschnitt	Feld	Format
13	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art der Identifizierung der Basiswerte	1 Buchstabe: I = ISIN B = Korb X = Index
14	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Identifizierung der Basiswerte	Identifizierung der Basiswerte, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Identifizierung der Basiswerte, Typ X: sofern verfügbar ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code
15	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Indikator des Basisindexes	Angabe des Indexes des variablen Zinssatzes. Vier Buchstaben: ESTR = EURSTR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA

	Abschnitt	Feld	Format
16	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Name des Basisindexes	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.
17	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Code des kundenspezifischen Korbs	Bis zu 72 alphanumerische Zeichen, bestehend aus der LEI des Korbstrukturierers, gefolgt von bis zu 52 alphanumerischen Zeichen.
18	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kennung der Bestandteile des Korbs	Identifizierung der Basiswerte, Typ B: Identifizierung aller Bestandteile durch ISIN nach ISO 6166
19	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung1	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
20	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Abwicklungswährung2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
21	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsbetrag	Positiver und negativer Wert, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
22	Abschnitt 2c – Bewertung	Währung der Bewertung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
23	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungszeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTTh:mm:ssZ
24	Abschnitt 2c – Bewertung	Bewertungsmethode	Vier Buchstaben: MTMA = Marktpreisbewertung MTMO = Modellpreisbewertung CCPV = CCP-Bewertung
25	Abschnitt 2c – Bewertung	Delta	Bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein Wert zwischen -1 und 1 (einschließlich -1 und 1) ist zulässig.
26	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	Boolescher Wert: TRUE = auf Portfoliobasis besichert FALSE = nicht Teil eines Portfolios
27	Abschnitt 2d – Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen Sonderzeichen sind nicht zulässig



	Abschnitt	Feld	Format
28	Abschnitt 2e – Risikominderung/Meldung	Bestätigungszeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
29	Abschnitt 2e – Risikominderung/Meldung	Bestätigt	Vier Buchstaben: — NCNF = unbestätigt — ECNF = elektronisch — YCNF = nichtelektronisch
30	Abschnitt 2f – Clearing	Clearingpflicht	TRUE = der Kontrakt gehört einer Kategorie von OTC-Derivaten an, die der Clearingpflicht unterliegt, und beide Gegenparteien des Kontrakts unterliegen der Clearingpflicht. FLSE = der Kontrakt gehört einer Kategorie von OTC-Derivaten an, die der Clearingpflicht unterliegt, aber eine oder beide Gegenparteien des Kontrakts unterliegt/unterliegen nicht der Clearingpflicht, oder der Wert „UKWN“ – der Kontrakt gehört nicht einer Kategorie von OTC-Derivaten an, die der Clearingpflicht unterliegt
31	Abschnitt 2f – Clearing	Gecleart	1 Buchstabe: Y = ja, zentral gecleart, für Beta- und Gammatransaktionen N = nein, nicht zentral gecleart
32	Abschnitt 2f – Clearing	Clearing-Zeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
33	Abschnitt 2f – Clearing	Zentrale Gegenpartei	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
34	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art des Rahmenvertrags	Vier Buchstaben: „ISDA“ – ISDA „CDEA“ – FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement „EUMA“ – Europäischer Rahmenvertrag „FPCA“ – FOA Professional Client Agreement „FMAT“ – FBF-Rahmenvertrag über Transaktionen mit Terminfinanzinstrumenten „DERV“ – Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) „CMOP“ – Contrato Marco de Operaciones Financieras „CHMA“ – Schweizer Rahmenvertrag

	Abschnitt	Feld	Format
			„IDMA“ – Islamischer Derivat-Mastervertrag „EFMA“ – EFET-Rahmenvertrag „GMRA“ – GMRA „GMSL“ – GMSLA „BIAG“ = bilateraler Vertrag Oder „OTHR“ bei einem anderen Rahmenvertrag als den oben aufgeführten Verträgen
35	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Andere Art von Rahmenvertrag	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen
36	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Rahmenvertrag Version	Datumsangabe nach ISO 8601 (JJJJ)
37	Abschnitt 2g – Transaktionsetails	Gruppenintern	Boolescher Wert: TRUE = als gruppeninterne Transaktion abgeschlossener Kontrakt FALSE = Kontrakt, der nicht als gruppeninterne Transaktion abgeschlossen wurde
38	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR	Boolescher Wert: TRUE = aus einem PTRR-Ereignis hervorgegangener Kontrakt FALSE = nicht aus einem PTRR-Ereignis hervorgegangener Kontrakt
39	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Art des PTRR-Verfahrens	Vier Buchstaben: „PWOS“ – Portfoliokomprimierung ohne Drittdienstleister „PWAS“ – Portfoliokomprimierung mit einem Drittdienstleister oder einer CCP „PRBM“ – Portfolio Wiederausgleich/Margin-Management OTHR – Sonstiges
40	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	PTRR-Dienstleister	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
41	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Ausführungsplatz	Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383, vier alphanumerische Zeichen
42	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ausführungszeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTTh:mm:ssZ
43	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
44	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Ablaufdatum	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
45	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Datum der vorzeitigen Beendigung	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

	Abschnitt	Feld	Format
46	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Endgültiges vertragliches Abwicklungsdatum	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
47	Abschnitt 2c – Transaktionsdetails	Art der Lieferung	Vier Buchstaben: CASH = Bar PHYS = Physisch OPTL = Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten
48	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis	<p>— Wird der Preis als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>— Wird der Preis als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Hat der Wert mehr als zehn Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
49	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
	Die Felder 50 bis 52 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Preislisten auszufüllen.		
50	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Geltungsbeginn des Preises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
51	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nicht aktualisierter Endtermin des Preises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
52	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltender Preis zwischen dem nicht aktualisierten Geltungsbeginn und dem Endtermin	<p>— Wird der Preis als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>— Wird der Preis als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Hat der Wert mehr als zehn Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p>

	Abschnitt	Feld	Format
			<p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
53	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Preis des Transaktionspakets	<p>— Wird der Preis des Transaktionspakets als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>— Wird der Preis des Transaktionspakets als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Hat der Wert mehr als zehn Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
54	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Währung des Preises des Transaktionspakets	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
55	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 1	<p>Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p>
56	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 1	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
	Die Felder 57 bis 59 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennbeträgen auszufüllen.		
57	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 1	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
58	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 1	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

	Abschnitt	Feld	Format
59	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
60	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 1	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
	Die Felder 61 bis 63 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennmengen auszufüllen.		
61	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 1	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
62	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 1	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
63	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 1 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
64	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 2	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
65	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen

	Abschnitt	Feld	Format
	Die Felder 66 bis 68 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennbeträgen auszufüllen.		
66	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
67	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
68	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
69	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 2	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
	Die Felder 70 bis 72 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennmengen auszufüllen.		
70	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
71	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
72	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.

	Abschnitt	Feld	Format
	Der Abschnitt der Felder 73 bis 78 ist wiederholbar		
73	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Art der Zahlung	<p>Vier Buchstaben:</p> <p>UFRO = Abschlusszahlung, d. h. die erste Zahlung einer der Gegenparteien, um eine Transaktion entweder auf den beizulegenden Zeitwert zu bringen oder aus einem anderen Grund, der hinter einer außerbörslichen Transaktion stehen kann</p> <p>UWIN = Auslaufen oder vollständige Beendigung, d. h. die Abschlusszahlung, wenn eine Transaktion vor ihrem Endtermin ausläuft; Zahlungen aufgrund der vollständigen Beendigung von Derivategeschäften</p> <p>PEXH = wichtigster Austausch, d. h. Austausch von Nennwerten für „Cross-Currency Swaps“</p>
74	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsbetrag	<p>Bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Jeder Wert größer oder gleich Null ist zulässig.</p>
75	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Zahlungswährung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
76	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungstermin	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
77	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahler	<p>— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.</p> <p>Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.</p>
78	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsempfänger	<p>— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.</p>

	Abschnitt	Feld	Format
			Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.
79	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz Leg 1 oder Kupon	Positiver und negativer Wert, ausgedrückt als Prozentsatz mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
80	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodell1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodell2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodell3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen
81	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit



	Abschnitt	Feld	Format
82	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator für die Zahlungsfrequenz für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
83	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 1	Wenn der variable Zinssatz eine ISIN hat, ist der ISIN-Code für diesen Zinssatz anzugeben.
84	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 1	Angabe des Indexes des variablen Zinssatzes. Vier Buchstaben: ESTR = EURSTR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA

	Abschnitt	Feld	Format
85	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 1	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.
86	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 1	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen
87	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
88	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
89	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 1 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit

	Abschnitt	Feld	Format
90	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 1 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
91	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
92	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
93	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 1	— Wird der Spread als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst. — Wird der Spread als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). — Wenn der Spread als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %).
94	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads von Leg 1	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
95	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz von Leg 2	Positiver und negativer Wert, ausgedrückt als Prozentsatz mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
96	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode Festsatz von Leg 2	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA

	Abschnitt	Feld	Format
			<p>A009 = Actual365LorActuActubasisRule</p> <p>A010 = ActualActualAFB</p> <p>A011 = IC30360ICMAor30360basicrule</p> <p>A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2</p> <p>A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3</p> <p>A014 = Actual365NL</p> <p>A015 = ActualActualUltimo</p> <p>A016 = IC30EPlus360</p> <p>A017 = Actual364</p> <p>A018 = Business252</p> <p>A019 = Actual360NL</p> <p>A020 = 1/1</p> <p>NARR = Meldebogen</p>
97	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 2	<p>Vier Buchstaben:</p> <p>DAIL = täglich</p> <p>WEEK = wöchentlich</p> <p>MNTH = monatlich</p> <p>YEAR = jährlich</p> <p>ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen</p> <p>EXPI = Zahlung bei Fälligkeit</p>
98	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz Festzinsseite von Leg 2	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
99	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 2	Wenn der variable Zinssatz eine ISIN hat, ist der ISIN-Code für diesen Zinssatz anzugeben.
100	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 2	<p>Angabe des Indexes des variablen Zinssatzes. Vier Buchstaben:</p> <p>ESTR = EURSTR</p> <p>SONA = SONIA</p> <p>SOFR = SOFR</p> <p>EONA = EONIA</p> <p>EONS = EONIA SWAP</p> <p>EURI = EURIBOR</p> <p>EUUS = EURODOLLAR</p> <p>EUCH = EuroSwiss</p> <p>GCFR = GCF REPO</p> <p>ISDA = ISDAFIX</p> <p>LIBI = LIBID</p> <p>LIBO = LIBOR</p> <p>MAAA = Muni AAA</p>

	Abschnitt	Feld	Format
			PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBNR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
101	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 2	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.
102	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 2	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252

	Abschnitt	Feld	Format
			A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen
103	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
104	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
105	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 2 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
106	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 2 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
107	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
108	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen

	Abschnitt	Feld	Format
109	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 2	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Wird der Spread als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst.</li> <li>— Wird der Spread als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %).</li> <li>— Wenn der Spread als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %).</li> </ul>
110	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spread von Leg 2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
111	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread des Transaktionspakets	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Wird der Spread des Transaktionspakets als monetärer Wert mitgeteilt – ein positiver und negativer Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, die bis zu 13 Dezimalstellen umfassen. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</li> <li>— Wird der Spread des Transaktionspakets als Prozentwert mitgeteilt – ein positiver und negativer Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Hat der Wert mehr als zehn Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</li> <li>— Wenn der Spread des Transaktionspakets als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %).</li> </ul> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
112	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads des Transaktionspakets	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
113	Abschnitt 2i – Devisen	Wechselkurs 1	<p>Ein Wert größer als Null, bis zu 18 numerische Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p>
114	Abschnitt 2i – Devisen	Devisenterminkurs	<p>Ein Wert größer als Null, bis zu 18 numerische Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p>

	Abschnitt	Feld	Format
115	Abschnitt 2i – Devisen	Umrechnungsbasis	Sieben Zeichen, die zwei Währungscode nach ISO 4217 darstellen, getrennt durch „/“, ohne Beschränkung der Reihenfolge des Währungspaares.  Der erste Währungscode gibt die Währung der Einheit, der zweite die quotierte Währung an.
116	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Basisprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.
117	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Unterprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.
118	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Weiteres Unterprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.
119	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferpunkt oder -zone	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code.  Wiederholbares Feld.
120	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Kuppelstelle/ Kopplungspunkt	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code.
121	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Art der Last	BSLD = Grundlast PKLD = Spitzenlast OFFP = Schwachlast HABH = Stunde/Blockstunden SHPD = geformt („shaped“) GASD = Gastag OTHR = Sonstige
	Der Abschnitt der Felder 122 bis 131 ist wiederholbar		
122	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startzeitpunkt des Lieferintervalls	hh:mm:ssZ
123	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endzeitpunkt des Lieferintervalls	hh:mm:ssZ



	Abschnitt	Feld	Format
124	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startdatum der Lieferung	Datum nach ISO 8601 (JJJJ-MM-TT)
125	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endtermin der Lieferung	Datum nach ISO 8601 (JJJJ-MM-TT)
126	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Laufzeit	MNUT = Minuten HOUR = Stunde DASD = Tag WEEK = Woche MNTH = Monat QURT = Quartal SEAS = Saison YEAR = Jahr OTHR = Sonstige
127	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Wochentage	WDAY = Werktag WEND = Wochenende MOND = Montag TUED = Dienstag WEDD = Mittwoch THUD = Donnerstag FRID = Freitag SATD = Samstag SUND = Sonntag XBHL – ausgenommen Feiertage IBHL – einschließlich Feiertage Es können mehrere Werte angegeben werden
128	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferkapazität	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
129	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Mengeneinheit	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW

	Abschnitt	Feld	Format
			GWHH = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = KTherm/d MTMD = MTherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100 MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Preis-/Zeitintervallmenge	Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
131	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Währung der Preis-/Zeitintervallmenge	Währungskürzel nach ISO 4217, dreistelliger alphabetischer Code
132	Abschnitt 2l – Optionen	Art der Option	Vier Buchstaben: PUTO = Put CALL = Call OTHR = wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt
133	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungsart der Option	Vier Buchstaben: AMER = Amerikanische Option BERM = Bermuda-Option EURO = Europäische Option
134	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis	— Wenn der Ausübungspreis als monetärer Wert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst (z. B. 6,39 USD, ausgedrückt als 6.39) für Aktienoptionen, Waren-/Rohstoffoptionen, Devisenoptionen und ähnliche Produkte. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.

	Abschnitt	Feld	Format
			<p>— Wenn der Ausübungspreis als Prozentwert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.1 statt 2,1 %), für im Spread notierte Zinsoptionen, Zinssätze und Kreditswaptions sowie ähnliche Produkte.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
	Die Felder 135 bis 137 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Ausübungspreisen auszufüllen.		
135	Abschnitt 2l–Optionen	Geltungsbeginn des Ausübungspreises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
136	Abschnitt 2l–Optionen	Endtermin des Ausübungspreises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
137	Abschnitt 2l–Optionen	Ausübungspreis, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn gilt	<p>— Wenn der Ausübungspreis als monetärer Wert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst (z. B. 6,39 USD, ausgedrückt als 6.39) für Aktienoptionen, Waren-/Rohstoffoptionen, Devisenoptionen und ähnliche Produkte. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.</p> <p>— Wenn der Ausübungspreis als Prozentwert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.1 statt 2,1 %), für im Spread notierte Zinsoptionen, Zinssätze und Kreditswaptions sowie ähnliche Produkte.</p> <p>Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.</p> <p>Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.</p>
138	Abschnitt 2l–Optionen	Währung/ Währungspaar des Ausübungspreises	<p>Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen, oder</p> <p>für Devisenoptionen: sieben Zeichen, die zwei Währungscode nach ISO 4217 darstellen, getrennt durch „/“, ohne Beschränkung der Reihenfolge des Währungspaares.</p> <p>Der erste Währungscode gibt die Basiswährung, der zweite die quotierte Währung an.</p>

	Abschnitt	Feld	Format
139	Abschnitt 2l – Optionen	Betrag der Optionsprämie	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
140	Abschnitt 2l – Optionen	Währung der Optionsprämie	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
141	Abschnitt 2l – Optionen	Zahlungstermin der Optionsprämie	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
142	Abschnitt 2i – Optionen	Fälligkeitsdatum des Basiswerts	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
143	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Rang	Vier Buchstaben:  SNDB = Vorrangig, z. B. vorrangige, unbesicherte Schuldtitel (Unternehmen/Finanzinstitute), Staatsschuldtitel in Fremdwährung (Regierungen)  SBOD = Nachrangig, z. B. nachrangige oder Lower-Tier-2-Schuldtitel (Banken), nachrangige (junior) oder Upper-Tier-2-Schuldtitel (Banken)  OTHR = sonstige, z. B. Vorzugsaktien oder Kernkapital (Banken) oder andere Kreditderivate
144	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Referenzeinrichtung	Ländercode nach ISO 3166 – Ländercode aus zwei Buchstaben,  oder  Ländercode nach ISO 3166-2 – Ländercode aus zwei Buchstaben, gefolgt von einem Bindestrich („-“) und einem Länderuntercode von bis zu drei alphanumerischen Zeichen,  oder  Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20-stelliger alphanumerischer Code
145	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Serien	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen
146	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Version	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen
147	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Indexfaktor	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1).  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.

	Abschnitt	Feld	Format
148	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Tranche	Boolescher Wert: TRUE = in Tranchen FALSE = nicht in Tranchen
149	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Attachment-Point des Kreditderivat-Swap-Index (CDS-Index)	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
150	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Detachment-Point des CDS-Index	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
151	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Vorgangs	Vier Buchstaben: NEWT = Neu MODI = Änderung CORR = Korrektur TERM = Beendigung ERROR = Fehler REVI = Wiederherstellung VALU = Bewertung POSC = Positionskomponente
152	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ereignisart	Vier Buchstaben: TRAD = Handel NOVA = Step-in COMP = PTRR ETRM = vorzeitige Kündigung CLRG = Clearing EXER = Ausübung ALOC = Zuweisung CREV = Kreditereignis CORP = Unternehmensereignis INCP = Aufnahme in die Position UPDT = Aktualisierung
153	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Datum des Ereignisses	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

	Abschnitt	Feld	Format
154	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ebene	Vier Buchstaben: TCTN = Geschäft PSTN = Position

Tabelle 3

	Abschnitt	Feld	Format
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format (koordinierte Weltzeit) JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (Meldende Gegenpartei)	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.
5	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	Boolescher Wert: — TRUE — FALSE, für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.
6	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.  Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.
7	Sicherheiten	Zeitstempel der Sicherheiten	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
8	Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	Boolescher Wert: TRUE = auf Portfoliobasis besichert FALSE = nicht Teil eines Portfolios

	Abschnitt	Feld	Format
9	Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen Sonderzeichen sind nicht zulässig
10	Sicherheiten	UTI	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
11	Sicherheiten	Kategorie der Besicherung	Vier Buchstaben: UNCL = unbesichert PRC1 = teilbesichert: nur Gegenpartei 1 PRC2 = teilbesichert: nur Gegenpartei 2 PRCL = teilbesichert OWC1 = einseitig besichert: nur Gegenpartei 1 OWC2 = einseitig besichert: nur Gegenpartei 2 OWP1 = einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 1 OWP2 = einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 2 FLCL = vollständig besichert Gemäß Artikel 5 der vorliegenden Verordnung einzutragen
12	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
13	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
14	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
15	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.

	Abschnitt	Feld	Format
16	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
17	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
18	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte überschüssige Sicherheiten	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
19	Sicherheiten	Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
20	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Ersteinschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
21	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Ersteinschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
22	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen Ersteinschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
23	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Nachschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.



	Abschnitt	Feld	Format
24	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene Nachschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
25	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen Nachschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
26	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 entgegengenommene überschüssige Sicherheiten	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an.  Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
27	Sicherheiten	Währung der entgegengenommenen überschüssigen Sicherheiten	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
28	Sicherheiten	Art des Vorgangs	„MARU“ = Aktualisierung der Einschuss-/ Nachschusszahlungen „CORR“ = Korrektur
29	Sicherheiten	Datum des Ereignisses	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

Tabelle 4

**Klassifizierung von Waren**

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„AGRI“ = Agrarprodukt	„GROS“ = Getreide, Ölsaaten	„FWHT“ = Futterweizen „SOYB“ = Sojabohnen „CORN“ = Mais „RPSD“ = Raps „RICE“ = Reis „OTHR“ = Sonstiges
	„SOFT“ = Weichwaren	„CCOA“ = Kakao „ROBU“ = Robusta-Kaffee „WHSG“ = Weißzucker „BRWN“ = Rohzucker „OTHR“ = Sonstiges
	„POTA“ = Kartoffeln	
	„OOLI“ = Olivenöl	„LAMP“ = Lampantöl „OTHR“ = Sonstiges

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
	„DIRY“ = Molkereiprodukte	
	„FRST“ = forstwirtschaftliche Produkte	
	„SEAF“ = Meeresfrüchte	
	„LSTK“ = Vieh	
	„GRIN“ = Getreide	„MWHT“ = Mahlweizen „OTHR“ = Sonstiges
	„OTHR“ = Sonstiges	
„NRGY“ = Energie	„ELEC“ = Strom	„BSLD“ = Grundlast „FITR“ = finanzielle Übertragungsrechte „PKLD“ = Spitzenlast „OFFP“ = Schwachlast „OTHR“ = Sonstige
	„NGAS“ = Erdgas	„GASP“ = GASPOOL „LNGG“ = LNG „NBPG“ = NBP „NCGG“ = NCG „TTFG“ = TTF „OTHR“ = Sonstiges
	„OILP“ = Öl	„BAKK“ = Bakken „BDSL“ = Biodiesel „BRNT“ = Brent „BRNX“ = Brent NX „CNDA“ = Kanadisch „COND“ = Kondensat „DSEL“ = Diesel „DUBA“ = Dubai „ESPO“ = ESPO „ETHA“ = Ethanol „FUEL“ = Brennstoff „FOIL“ = Motorentreibstoffe „GOIL“ = Gasöl „GSLN“ = Ottokraftstoff „HEAT“ = Heizöl „JTFL“ = Flugturbinenkraftstoff „KERO“ = Kerosin „LLSO“ = Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ = MARS „NAPH“ = Naphtha „NGLO“ = NGL „TAPI“ = Tapis

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
		„URAL“ = Ural „WTIO“ = WTI „OTHR“ = Sonstiges
	„COAL“ = Kohle „INRG“ = Arbitragegeschäft „RNGG“ = erneuerbare Energien „LGHT“ = leichte Bestandteile „DIST“ = Destillate „OTHR“ = Sonstiges	
„ENVR“ = Umwelt	„EMIS“ = Emissionen	„CERE“ = CER „ERUE“ = ERU „EUAE“ = EUA „EUAA“ = EUAA „OTHR“ = Sonstiges
	„WTHR“ = Wetter „CRBR“ = Kohlenstoff „OTHR“ = Sonstiges	
„FRGT“ = Fracht	„WETF“ = Nassfracht	„TNKR“ = Tanker „OTHR“ = Sonstiges
	„DRYF“ = Trockenfracht	„DBCR“ = Massengutschiff „OTHR“ = Sonstiges
	„CSHP“ = Containerschiffe	
	„OTHR“ = Sonstiges	
„FRTL“ = Dünger	„AMMO“ = Ammoniak „DAPH“ = – DAP (Diammoniumphosphat) „PTSH“ = Kali „SLPH“ = Schwefel „UREA“ = Harnstoff „UAAN“ = ( Harnstoff und Ammoniumnitrat) „OTHR“ = Sonstiges	
„INDP“ = Industrieerzeugnisse	„CSTR“ = Baugewerbe/Bau „MFTG“ = Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„METL“ = Metalle	„NPRM“ = Nichtedelmetalle	„ALUM“ = Aluminium „ALUA“ = Aluminiumlegierung „CBLT“ = Kobalt „COPR“ = Kupfer „IRON“ = Eisenerz „LEAD“ = Blei „MOLY“ = Molybdän „NASC“ = NASAAC „NICK“ = Nickel „STEL“ = Stahl „TINN“ = Zinn „ZINC“ = Zink „OTHR“ = Sonstiges
	„PRME“ = Edelmetalle	„GOLD“ = Gold „SLVR“ = Silber „PTNM“ = Platin „PLDM“ = Palladium „OTHR“ = Sonstiges
„MCEX“ = Multi Commodity exotisch		
„PAPR“ = Papier	„CBRD“ = Wellpappenrohpapier „NSPT“ = Zeitungsdruckpapier „PULP“ = Zellstoff „RCVP“ = Recyclingpapier „OTHR“ = Sonstiges	
„POLY“ = Polypropylen	„PLST“ = Kunststoff „OTHR“ = Sonstiges	
„INFL“ = Inflation		
„OEST“ = Offizielle Wirtschaftsstatistik		
„OTHC“ = Sonstige C10-Derivate entsprechend der Definition in Anhang III Tabelle 10.1 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583 der Kommission <sup>(1)</sup>		
„OTHR“ = Sonstiges		

<sup>(1)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2017/583 der Kommission vom 14. Juli 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards zu den Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Anleihen, strukturierte Finanzprodukte, Emissionszertifikate und Derivate (Abl. L 87 vom 31.3.2017, S. 229).



ISSN 1977-0642 (elektronische Ausgabe)  
ISSN 1725-2539 (Papierausgabe)