

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2019/358 DER KOMMISSION**vom 13. Dezember 2018****zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Erhebung, die Überprüfung, die Aggregation, den Vergleich und die Veröffentlichung von Daten über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) durch 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) 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⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 5 Absatz 7 Buchstabe a und Artikel 12 Absatz 3 Buchstaben a und b,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Um bei den Angaben, die den Transaktionsregistern zu den Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften übermittelt werden, eine hohe Datenqualität zu gewährleisten, sollten Transaktionsregister die Richtigkeit der Angaben über die meldende Stelle, die logische Konsistenz der Meldesequenz und die Vollständigkeit und Richtigkeit der Einzelheiten dieser Wertpapierfinanzierungsgeschäfte überprüfen.
- (2) Aus dem gleichen Grund sollten Transaktionsregister bei jeder SFT-Meldung die darin enthaltenen Angaben abgleichen. Damit die Transaktionsregister diesen Abgleich auf konsistente Weise durchführen können, und zur Minderung des Risikos, dass bei bestimmten Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften 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 Wertpapierfinanzierungsgeschäften jedoch möglicherweise voneinander ab. Damit geringfügige Differenzen bei den zu einem Wertpapierfinanzierungsgeschäft gemeldeten Einzelheiten die Behörden nicht daran hindern, die Daten mit einem angemessenen Konfidenzniveau zu analysieren, müssen deshalb bestimmte Toleranzen festgelegt werden.
- (3) Es ist zu erwarten, dass die meldenden Stellen ihre Meldungen im Laufe der Zeit verbessern werden und dies die Zahl der zurückgewiesenen Meldungen verringern wird; auch der Abgleich der Meldungen dürfte sich dadurch verbessern. Um insbesondere zu verhindern, dass unmittelbar nach Geltungsbeginn der Meldepflicht eine große Zahl nicht abgeglicherer Geschäfte aufläuft, sollte ihnen zur Anpassung an die Meldeanforderungen allerdings genügend Zeit eingeräumt werden. In einer ersten Phase sollte daher nur eine beschränkte Zahl von Daten abgeglichen werden.
- (4) Die meldenden sowie gegebenenfalls die für die Meldung verantwortlichen Stellen sollten verfolgen können, ob sie ihre Meldepflichten nach der Verordnung (EU) 2015/2365 erfüllen. Aus diesem Grund sollten sie täglich auf bestimmte, diese Meldungen betreffende Angaben zugreifen können, wozu auch das Ergebnis der Überprüfung dieser Meldungen 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.
- (5) Im Interesse der Geschlossenheit der Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften sollte der in Artikel 12 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannte direkte und sofortige Zugang auf harmonisierte und konsistente Weise gewährt werden. Um die Meldungen zu standardisieren, die Kosten für die Branche so gering wie möglich zu halten und für Vergleichbarkeit und konsistente Datenaggregation zwischen den Transaktionsregistern zu sorgen, sollten alle Output-Meldungen und jeder diesbezügliche Austausch mithilfe von Vorlagen im XML-Format und nach einer in der Finanzbranche weitverbreiteten Methodik erfolgen.
- (6) Um zu bestimmen, wo potenzielle Systemrisiken oder nicht systembedingte Risiken für die Finanzstabilität bestehen, ist es von zentraler Bedeutung, dass die in Artikel 12 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannten Stellen auf Positionsebene auf die Daten von Risikopositionen zwischen zwei bestimmten Gegenparteien zugreifen können.
- (7) Um bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften für die Öffentlichkeit ein angemessenes Maß an Transparenz zu gewährleisten, sollten die für die Aggregation von Positionen herangezogenen Kriterien der allgemeinen

⁽¹⁾ ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1.

Öffentlichkeit das Verständnis der SFT-Märkte ermöglichen, ohne die Vertraulichkeit der an Transaktionsregister gemeldeten Daten zu beeinträchtigen. Wie häufig und mit welchem Detaillierungsgrad ein Transaktionsregister aggregierte Positionen gemäß Artikel 12 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2015/2365 veröffentlicht, sollte ausgehend von dem damit zusammenhängenden Rahmen bestimmt werden, den die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates ^(?) für Derivatekontrakte vorsieht.

- (8) Die vorliegende Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission nach dem in Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ^(?) genannten Verfahren von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (9) Gegenstand dieser Verordnung sind operationelle Standards für die Datenerhebung, -aggregation und den Datenvergleich durch Transaktionsregister, sowie die Verfahren, die die Transaktionsregister zur Überprüfung der Vollständigkeit und Richtigkeit der ihnen gemeldeten Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften anwenden müssen. Um Kohärenz zwischen diesen Bestimmungen zu gewährleisten und den Transaktionsregistern einen besseren Überblick zu verschaffen, sollten die betreffenden technischen Regulierungsstandards in einer einzigen Verordnung zusammengefasst werden.
- (10) Die ESMA hat zu diesen Standardentwürfen offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt –

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Überprüfung der SFT-Meldungen durch die Transaktionsregister

- (1) Ein Transaktionsregister überprüft eine erhaltene SFT-Meldung in allen folgenden Punkten:
 - a) die Angaben zu der in Anhang I Tabelle 1 Feld 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 der Kommission ^(*) genannten meldenden Stelle;
 - b) dass das zur Meldung eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts verwendete XML-Schema gemäß Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 der in ISO 20022 festgelegten Methodik entspricht;
 - c) dass die meldende Einrichtung – sollte es sich bei dieser nicht um die in Anhang I Tabelle 1 Feld 3 der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 genannte meldende Gegenpartei handeln – befugt ist, die Meldung im Namen der meldenden Gegenpartei vorzunehmen, es sei denn, es liegt der in Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannte Fall vor;
 - d) dass dieselbe SFT-Meldung nicht bereits übermittelt wurde;
 - e) dass eine SFT-Meldung der Kategorie „Änderung“ eine bereits übermittelte SFT-Meldung betrifft;
 - f) dass eine SFT-Meldung der Kategorie „Änderung“ kein als annulliert gemeldetes Wertpapierfinanzierungsgeschäft betrifft;
 - g) dass ein bereits gemeldetes Wertpapierfinanzierungsgeschäft durch die SFT-Meldung nicht als „Neu“ ausgewiesen wird;
 - h) dass ein bereits gemeldetes Wertpapierfinanzierungsgeschäft durch die SFT-Meldung nicht als „Positionskomponente“ ausgewiesen wird;

^(?) 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).

^(?) 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).

^(*) Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit der Meldung der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Änderung der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 im Hinblick auf die Verwendung von Codes für die Meldung von Derivatekontrakten (siehe Seite 85 dieses Amtsblatts).

- i) dass die im Rahmen eines zuvor gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfts übermittelten Angaben zur meldenden Stelle, zur meldenden Gegenpartei oder zu der anderen Gegenpartei dieses Geschäfts durch die SFT-Meldung nicht geändert werden sollen;
- j) dass eine bestehende SFT-Meldung durch Angabe eines vom Valutierungsdatum abweichenden Fälligkeitsdatums nicht durch die SFT-Meldung geändert werden soll;
- k) die Richtigkeit und Vollständigkeit der SFT-Meldung.

(2) Ein Transaktionsregister muss überprüfen, ob bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften, bei denen das Feld 72 „Signalisierung eines unbesicherten Wertpapierleihgeschäfts“ der Tabelle 2 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 das Attribut „falsch“ erhalten hat, die Felder 73 bis 96 derselben Tabelle Angaben zu Sicherheiten enthalten. Das Transaktionsregister teilt der meldenden Stelle und der meldenden Gegenpartei sowie gegebenenfalls der für die Meldung verantwortlichen Stelle gemäß Artikel 3 der vorliegenden Verordnung das Ergebnis der Überprüfung mit.

(3) SFT-Meldungen, die eine der in Absatz 1 genannten Anforderungen nicht erfüllen, werden vom Transaktionsregister zurückgewiesen und einer der in Anhang I Tabelle 2 genannten Kategorien zugeordnet.

(4) Ein Transaktionsregister legt der meldenden Stelle und der meldenden Gegenpartei sowie gegebenenfalls der für die Meldung verantwortlichen Stelle innerhalb von 60 Minuten nach Erhalt einer SFT-Meldung detaillierte Informationen über die Ergebnisse der in Absatz 1 genannten Datenüberprüfung vor. Diese Ergebnisse stellt das Transaktionsregister in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema bereit. Zu diesen Ergebnissen zählen gegebenenfalls auch die genauen Gründe für die Zurückweisung einer SFT-Meldung gemäß Absatz 3.

Artikel 2

Datenabgleich durch die Transaktionsregister

(1) Ein Transaktionsregister bemüht sich um Abgleich eines gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfts und führt dazu die in Absatz 2 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 Wertpapierfinanzierungsgeschäfts unterliegen der Meldepflicht;
- c) das Transaktionsregister hat im Anschluss an die SFT-Meldung keine Folgemeldung der Kategorie „Fehler“ erhalten.

(2) Sind alle in Absatz 1 genannten Bedingungen erfüllt, führt das Transaktionsregister die folgenden Schritte durch und verwendet dabei für jedes der Felder in Anhang I Tabelle 1 die letzten gemeldeten Werte:

- a) nach Erhalt einer SFT-Meldung überprüft das Transaktionsregister, ob es von oder im Namen der anderen Gegenpartei eine korrespondierende SFT-Meldung erhalten hat;
- b) hat das Transaktionsregister die unter a genannte korrespondierende SFT-Meldung 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 SFT-Meldung ausgewiesenen Felder mit: „Individuelle Transaktionskennziffer“, „Meldende Gegenpartei“, „Andere Gegenpartei“ und „Art der Rahmenvereinbarung“;
- c) stellt das Transaktionsregister fest, dass ein anderes Transaktionsregister die unter Buchstabe a genannte korrespondierende SFT-Meldung erhalten hat, so tauscht es mit diesem die Einzelheiten des gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfts in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema aus;
- d) vorbehaltlich des Buchstaben e betrachtet ein Transaktionsregister ein gemeldetes Wertpapierfinanzierungsgeschäft als abgeglichen, wenn sich die Einzelheiten dieses Geschäfts mit den Einzelheiten des unter Buchstabe a genannten korrespondierenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfts decken;
- e) ein Transaktionsregister bemüht sich, bei einem gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäft die Felder mit den Kreditdaten und die Felder mit den sicherheitenbezogenen Daten getrennt voneinander abzugleichen, und legt dabei die in Anhang I Tabelle 1 festgelegten Toleranzlimits und den dort festgelegten jeweiligen Geltungsbereich zugrunde;

- f) im Anschluss daran weist das Transaktionsregister bei jedem gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäft den Anhang I Tabelle 3 genannten Kategorien, in denen ein Abgleich vorgenommen wird, einen Wert zu;
- g) das Transaktionsregister schließt die unter den Buchstaben a bis f genannten Schritte frühestmöglich ab und unternimmt keinen dieser Schritte an einem Arbeitstag nach 18.00 Uhr koordinierter Weltzeit;
- h) kann ein Transaktionsregister ein gemeldetes Wertpapierfinanzierungsgeschäft nicht abgleichen, so bemüht es sich, den Abgleich der Einzelheiten dieses gemeldeten Geschäfts am darauffolgenden Arbeitstag vorzunehmen. Dreißig Kalendertage nach der gemeldeten Fälligkeit eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts oder nach Erhalt einer dieses Geschäft betreffenden Meldung der Kategorie „Beendigung“ oder „Positionskomponente“ bemüht sich das Transaktionsregister nicht länger um Abgleich dieses Geschäfts.
- (3) Ein Transaktionsregister bestätigt jedem anderen Transaktionsregister, mit dem es gemeldete Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeglichen hat, am Ende jedes Arbeitstages die Gesamtzahl der gemeldeten abgeglichenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte.
- (4) Ein Transaktionsregister übermittelt der meldenden Stelle und der meldenden Gegenpartei sowie gegebenenfalls der für die Meldung verantwortlichen Stelle spätestens sechzig Minuten nach Abschluss des in Absatz 2 Buchstabe g beschriebenen Abgleichsprozesses die Ergebnisse des von ihm für die gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte durchgeführten Abgleichsprozesses. 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 3

Tagesendstandsmittelungen

Ein Transaktionsregister stellt der meldenden Stelle und der meldenden Gegenpartei sowie gegebenenfalls der für die Meldung verantwortlichen Stelle am Ende jedes Arbeitstages zu den betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäften die nachstehend genannten Angaben in einem XML-Format und einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema bereit:

- a) die im Laufe dieses Tages gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte;
- b) das letzte Handelsstadium der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, die noch nicht fällig oder für die keine Meldungen der Kategorie „Fehler“, „Beendigung“ oder „Positionskomponente“ vorgenommen worden sind;
- c) die individuelle Transaktionskennziffer (UTI) der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, bei denen das Feld 72 der Tabelle 2 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 das Attribut „falsch“ erhalten hat und in den Feldern 73 bis 96 derselben Tabelle noch keine Angaben zu Sicherheiten gemacht wurden;
- d) die im Laufe dieses Tages zurückgewiesenen SFT-Meldungen;
- e) den Stand des Abgleichs bei allen gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit Ausnahme der bereits abgelaufenen oder derjenigen, für die mehr als einen Monat vor diesem Arbeitstag SFT-Meldungen der Kategorie „Beendigung“ oder „Positionskomponente“ eingegangen sind.

Artikel 4

Zugang zu den Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Ein Transaktionsregister gewährt den in Artikel 12 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannten Stellen auch in Fällen, in denen eine Delegation nach Artikel 28 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 vorliegt, in elektronischer und maschinenlesbarer Form gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2019/357 der Kommission^(?) einen direkten und sofortigen Zugang zu den Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften.

Für die Zwecke des Unterabsatzes 1 verwendet ein Transaktionsregister ein XML-Format und ein nach der ISO-20022-Methodik entwickeltes Schema.

^(?) Delegierte Verordnung (EU) 2019/357 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Zugang zu den Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT) in Transaktionsregistern (siehe Seite 22 dieses Amtsblatts).

*Artikel 5***Berechnung von Daten auf Positionsebene und Zugang zu diesen Daten**

(1) Positionsdaten von Risikopositionen zwischen Gegenparteien werden von den Transaktionsregistern aufgeschlüsselt nach Darlehen und Sicherheiten berechnet. Bei der Berechnung der Positionsdaten wird Folgendes zugrunde gelegt:

- a) die Werte für die verschiedenen, in Anhang I Tabelle 3 aufgeführten Abgleichskategorien;
- b) die Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts;
- c) der Sektor der Gegenparteien;
- d) der Clearingstatus;
- e) ob das Geschäft an einem oder außerhalb eines Handelsplatzes stattgefunden hat;
- f) die Art der Sicherheit;
- g) die Währung der Geldseite;
- h) das Laufzeitband;
- i) die Abschlagskategorie;
- j) die Transaktionsregister, denen die andere Gegenpartei Einzelheiten des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts gemeldet hat.

(2) Ein Transaktionsregister stellt sicher, dass die in Artikel 12 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannten Stellen gemäß dem in der Delegierten Verordnung (EU) 2019/357 festgelegten Datenzugang auf die Positionsdaten zugreifen können.

(3) Die in Absatz 1 genannten Daten auf Positionsebene werden in elektronischer und maschinenlesbarer Form und in einem ein XML-Format sowie einem nach der ISO-20022-Methodik entwickelten Schema übermittelt.

(4) Der in Absatz 2 genannte Zugang wird frühestmöglich, spätestens jedoch am Arbeitstag nach Eingang einer nach Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2015/2365 vorgenommenen SFT-Meldung gewährt.

(5) Ein Transaktionsregister gewährt den in Artikel 12 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2015/2365 genannten Stellen gemäß dem in der Delegierten Verordnung (EU) 2019/357 festgelegten Datenzugang Zugang zu aggregierten Daten, die nach gemeinsam vereinbarten Standards und Verfahren für die globale Erhebung und Aggregation von SFT-Daten berechnet wurden.

*Artikel 6***Berechnung der für die Veröffentlichung bestimmten aggregierten Positionsdaten**

(1) Ein Transaktionsregister aggregiert Positionsdaten für die nachstehend genannten Werte und legt dabei die in den Absätzen 2 und 3 genannten Kriterien zugrunde:

- a) Kapitalbetrag von Rückkaufsvereinbarungen, „Buy-sell back“- oder „Sell-buy back“-Geschäften, aggregierte Menge ver- oder ausgeliehener Wertpapiere oder Waren und Höhe von Lombardkrediten;
- b) Zahl der zu den relevanten Wertpapierfinanzierungsgeschäften gehörenden UTIs;
- c) Marktwert der Sicherheit.

(2) Für alle zwischen Samstag, 00:00:00 UTC, und Freitag, 23:59:59 UTC, gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte der Kategorie „Neu“ aggregiert ein Transaktionsregister Positionsdaten und legt dabei die nachstehend genannten Kriterien und die in Anhang II Tabelle 1 aufgeführten dazugehörigen Werte zugrunde:

- a) den Standort der meldenden Gegenpartei oder gegebenenfalls der relevanten Zweigniederlassung;
- b) den Standort der anderen Gegenpartei oder gegebenenfalls der relevanten Zweigniederlassung;
- c) die Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts;
- d) den Status des Abgleichs des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts gemäß Anhang I Tabelle 3;

- e) die Art des Handelsplatzes, an dem das Wertpapierfinanzierungsgeschäft geschlossen wurde;
 - f) ob das Wertpapierfinanzierungsgeschäft gecleart wurde oder nicht;
 - g) die Methode, nach der die Sicherheit übertragen wurde;
 - h) jeden Index, der bei einem an einem anderen Ausführungsplatz als „XXXX“ gehandelten Wertpapierfinanzierungsgeschäft als Bezugswert herangezogen wird, wenn der dem Transaktionsregister mit Bezug auf diesen Index gemeldete aggregierte Nominalbetrag mehr als 5 Mrd. EUR beträgt und wenn die betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfte dem Transaktionsregister von mindestens sechs verschiedenen Gegenparteien gemeldet wurden.
- (3) Für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, die noch nicht fällig oder für die keine Meldungen der Kategorie „Fehler“, „Beendigung“ oder „Positionskomponente“ eingegangen sind, aggregiert ein Transaktionsregister bis Freitag 23:59:59 UTC Positionsdaten und legt dabei die nachstehend genannten Kriterien und die in Anhang II Tabelle 1 aufgeführten dazugehörigen Werte zugrunde:
- a) den Standort der meldenden Gegenpartei oder gegebenenfalls der relevanten Zweigniederlassung;
 - b) den Standort der anderen Gegenpartei oder gegebenenfalls der relevanten Zweigniederlassung;
 - c) die Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts;
 - d) den Status des Abgleichs des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts gemäß Anhang I Tabelle 3;
 - e) die Art des Handelsplatzes, an dem das Wertpapierfinanzierungsgeschäft geschlossen wurde;
 - f) ob das Wertpapierfinanzierungsgeschäft gecleart wurde oder nicht;
 - g) die Methode, nach der die Sicherheit übertragen wurde;
 - h) jeden Index, der bei einem an einem anderen Ausführungsplatz als „XXXX“ gehandelten Wertpapierfinanzierungsgeschäft als Bezugswert herangezogen wird, wenn der dem Transaktionsregister in Bezug auf diesen Index gemeldete aggregierte Nominalbetrag mehr als 5 Mrd. EUR beträgt und die betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfte dem Transaktionsregister von mindestens sechs verschiedenen Gegenparteien gemeldet wurden.
- (4) Ein Transaktionsregister verfügt über ein Verfahren, das es ermöglicht, bei den aggregierten Positionsdaten aus dem Rahmen fallende Werte zu ermitteln.
- (5) Ein Transaktionsregister verfügt über ein Verfahren, das es ermöglicht, aggregierte Positionsdaten einschließlich solcher, die aus Meldungen der Kategorie „Fehler“ stammen, zu berichtigen, solche Berichtigungen zu melden und die ursprünglichen und berichtigten Datenaggregationen zu veröffentlichen.

Artikel 7

Veröffentlichung aggregierter Positionsdaten

- (1) Ein Transaktionsregister veröffentlicht für alle bis 23:59:59 UTC am Freitag der Vorwoche gemeldeten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte allwöchentlich spätestens am Dienstagmittag auf seiner Website die nach Artikel 6 berechneten aggregierten Positionsdaten.
- (2) Alle aggregierten Positionsdaten werden in Euro und unter Verwendung der auf der EZB-Website am Freitag vor Veröffentlichung dieser Daten bekannt gegebenen Wechselkurse veröffentlicht.
- (3) Ein Transaktionsregister stellt sicher, dass die aggregierten Positionsdaten in der in Anhang II festgelegten Tabellenform veröffentlicht werden und heruntergeladen werden können.
- (4) Die von einem Transaktionsregister auf seiner Website veröffentlichten aggregierten Positionsdaten müssen dort mindestens 104 Wochen verbleiben.

Artikel 8

Inkrafttreten

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 13. Dezember 2018

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

ANHANG I

Tabelle 1

Felder für den Abgleich, Toleranzen und Starttermin für die Abgleichsphase

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Angaben zur Gegenpartei	ENTFÄLLT	Meldende Gegenpartei	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Angaben zur Gegenpartei	ENTFÄLLT	Seite der Gegenpartei	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Angaben zur Gegenpartei	ENTFÄLLT	Andere Gegenpartei	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Individuelle Transaktionskenn-ziffer („UTI“)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Gecleart	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Clearing-Zeitstempel	eine Stunde	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	CCP	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Handelsplatz	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Art der Rahmenvereinbarung	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Ausführungszeitstempel	eine Stunde	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Valutierungstermin (Starttermin)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Fälligkeitsdatum (Endtermin)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Kontraktende	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Mindestkündigungsfrist	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Frühester Call-back-Termin	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Allgemeiner Sicherheitsindikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Transaktionsdaten	Darlehen	DBV-Indikator (DBV = Delivery By Value)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Methode, nach der Sicherheiten bereitgestellt werden	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Unbefristet	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Optionale Kündigung	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Festsatz	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Zinsberechnungsmethode	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Variabler Zinssatz	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Referenzzeitraum für variablen Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Referenzzeitraum für variablen Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Zahlungshäufigkeit variabler Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Zahlungshäufigkeit variabler Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Anpassungshäufigkeit variabler Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Anpassungshäufigkeit variabler Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Spread	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Währungsbetrag Lombardkredite	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Währung Lombardkredite	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Transaktionsdaten	Darlehen	Angepasster Satz	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Datum Zinssatz	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Kapitalbetrag am Valutierungstermin	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Kapitalbetrag am Fälligkeitstermin	0,0005 %	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Währung Kapitalbetrag	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Art des Vermögenswerts	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Wertpapierkennung	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Wertpapierklassifizierung	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Zugrunde liegendes Produkt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Unterprodukt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Weiteres Unterprodukt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Menge oder Nominalbetrag	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Maßeinheit	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Währung des Nominalbetrags	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Wertpapier- oder Rohstoffpreis	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Währung des Preises	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Wertpapierqualität	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Fälligkeit des Wertpapiers	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Transaktionsdaten	Darlehen	Land des Emittenten	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Rechtsträgerkennung (LEI) des Emittenten	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Art des Wertpapiers	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Kreditbetrag	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Marktwert	0,0005 %	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Verbilligter Satz (fest)	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Verbilligter Satz (variabel)	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Zeitraum	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Multiplikator	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Spread des verbilligten Satzes	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Leihgebühr	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Transaktionsdaten	Darlehen	Ausschließlichkeitsvereinbarungen	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Darlehen	Ausstehender Lombardkredit	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Basiswährung des ausstehenden Lombardkredits	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Marktwert von Short-Positionen	0,0005 %	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Signalisierung eines unbesicherten Wertpapierleihgeschäfts („SL“, Securities Lending)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Besicherung des Nettoforderungswerts	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Valutierungstermin der Sicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Art der Sicherheitskomponente	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Höhe Barsicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Währung Barsicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Kennung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Klassifizierung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Zugrunde liegendes Produkt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Unterprodukt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Weiteres Unterprodukt	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Anzahl oder Nominalbetrag der Sicherheiten	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Maßeinheit der Sicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate

Tabelle	Abschnitt	Feld	Toleranz	Starttermin gemäß:
Transaktionsdaten	Besicherung	Währung des Nominalbetrags der Sicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Währung des Preises	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Preis pro Stück	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Marktwert der Sicherheit(en)	0,0005 %	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate
Transaktionsdaten	Besicherung	Abschlag oder Spanne	Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Qualität der Sicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Fälligkeitsdatum des Wertpapiers	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Land des Emittenten	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Rechtsträgerkennung (LEI) des Emittenten	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Art der Sicherheit(en)	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Möglichkeit der Wiederverwendung einer Sicherheit	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Besicherung	Kennung Sicherheitenkorb	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365
Transaktionsdaten	Darlehen	Stufe	Keine	Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365

Tabelle 2

Gründe für die Zurückweisung einer SFT-Meldung

Kategorie	Grund
Schema	Schema nicht vorschriftsmäßig
Berechtigung	die meldende Stelle ist nicht zur Meldung im Namen der meldenden Gegenpartei berechtigt
Logik	der für das Wertpapierfinanzierungsgeschäft angegebene Typ ergibt keinen Sinn
Geschäft	die Überprüfung hat ergeben, dass die Meldung in einem oder mehreren Punkten nicht den Vorgaben entspricht.

Tabelle 3

Ergebnisse des Abgleichprozesses

Kategorien, in denen ein Abgleich vorgenommen wird	Werte
Art der Meldung	Einseitig/Zweiseitig
Meldepflicht für beide Gegenparteien	Ja/Nein
Status Aufrechnung	Aufgerechnet/Nicht aufgerechnet
Status Darlehensabgleich	Abgeglichen/Nicht abgeglichen
Status Sicherheitenabgleich	Abgeglichen/Nicht abgeglichen
Weitere Änderungen	Ja/Nein

ANHANG II

Tabelle 1

Öffentliche Daten

Tabelle A. Aggregation

Datum	TR	Art der Aggregation	Art des Handelsplatzes	Standort der meldenden Gegenpartei	Standort der anderen Gegenpartei	Abgleich	Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts	Gecleart	Methode der Sicherheitenübertragung	Referenzindex ⁽¹⁾	Aggregierter Kreditbetrag	Aggregierte Anzahl der Transaktionen	Aggregierter Wert der Sicherheiten
20161007	EU TR	Gemeldet	XXXX	EWR	EWR	Zweiseitig, Kredit abgeglichen, Sicherheit nicht abgeglichen	Repo	Ja	TTCA	
...	...	Ausstehend	XOFF	Nicht-EWR	Nicht-EWR	Zweiseitig, Kredit abgeglichen, Sicherheit abgeglichen	BSB/SBB	Nein	SICA	
...	EWR MIC	Einseitig EWR, Kredit abgeglichen, Sicherheit abgeglichen	Wertpapier- oder Warenverleih- oder -leihgeschäfte	...	SIUR	
...	Nicht-EWR MIC	Lombardkredite
...

(¹) Hier sind die in Tabelle 2 Feld 25 „Angaben zu Darlehen und Sicherheiten“ in Anhang I der Delegierten Verordnung (EU) 2019/363 genannten jeweiligen Indizes anzugeben.