

II

(Rechtsakte ohne Gesetzescharakter)

VERORDNUNGEN

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2019/356 DER KOMMISSION

vom 13. Dezember 2018

zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur genauen Festlegung der an Transaktionsregister zu meldenden Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

(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 4 Absatz 9,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Zur Steigerung der Effizienz und zur besseren Nutzung der Ähnlichkeiten zwischen der Meldung von Derivaten und der Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften sollte die Pflicht zur Meldung der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften an Transaktionsregister gemäß Artikel 4 der Verordnung (EU) 2015/2365 an die Pflicht zur Meldung von Derivatgeschäften an Transaktionsregister gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ angepasst werden. Aus diesem Grund sollten an die Meldung der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften ähnliche Anforderungen gestellt werden wie an die Meldung der Einzelheiten von Derivatekontrakten.
- (2) Um die Effizienz und den Nutzen der zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften übermittelten Angaben zu gewährleisten, sollten bei der Festlegung, welche spezifischen Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften zu melden sind, die in der Verordnung (EU) 2015/2365 festgelegten Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften berücksichtigt werden. Bei der Meldung von Lombardgeschäften zielt die Verordnung (EU) 2015/2365 darauf ab, Geschäfte zu erfassen, die demselben Zweck dienen wie Pensionsgeschäfte, „Buy-sell back“-Geschäfte oder Wertpapierverleihgeschäfte und die dadurch, dass sie die Entstehung von Hebeleffekten, prozyklische Effekte und Verflechtungen an den Finanzmärkten begünstigen oder zur Liquiditäts- und Fristentransformation beitragen, ein ähnliches Risiko für die Finanzstabilität darstellen wie die genannten Geschäfte. Lombardgeschäfte umfassen Geschäfte mit Nachschussvereinbarung zwischen Finanzinstituten und ihren Kunden, bei denen Finanzinstitute ihren Kunden Primebroker-Dienstleistungen anbieten, nicht aber andere Kredite wie etwa Kredite für Zwecke der Unternehmensumstrukturierung, die trotz der Möglichkeit der Nutzung von Wertpapieren nicht zu den in der Verordnung (EU) 2015/2365 erfassten Systemrisiken beitragen.
- (3) Es ist wichtig, dass die Einzelheiten eines jeden von einer zentralen Gegenpartei gelearnten Wertpapierfinanzierungsgeschäfts korrekt gemeldet werden und problemlos identifiziert werden können und dies unabhängig davon, ob das Wertpapierfinanzierungsgeschäft am Abschlussstag oder zu einem späteren Datum gelearnt wurde.
- (4) Um vollständige Meldungen auch für den Fall zu gewährleisten, dass am Tag des Geschäftsabschlusses keine genauen Angaben zu den Sicherheiten vorliegen, sollten die Gegenparteien die Angaben zu Sicherheiten aktualisieren, sobald ihnen diese zur Verfügung stehen, spätestens jedoch am Arbeitstag nach dem Valutierungstermin des entsprechenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfts.

⁽¹⁾ ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1.

⁽²⁾ 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).

- (5) Um Behörden, die bei Transaktionsregistern die Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften abrufen, aussagekräftigere Informationen zur Verfügung zu stellen, sollten die Gegenparteien den Transaktionsregistern auch die internationale Wertpapier-Identifikationsnummer („ISIN“) jedes Sicherheitenkorbs, den sie zur Besicherung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften halten, melden, sofern es für den betreffenden Korb eine ISIN gibt.
- (6) Wenn Gegenparteien Sicherheiten auf Basis des Nettoforderungswerts stellen, der sich aus der Aufrechnung verschiedener Wertpapierfinanzierungsgeschäfte zwischen zwei Gegenparteien ergibt, so ist die genaue Zuordnung von Sicherheiten zu einzelnen Wertpapierfinanzierungsgeschäften häufig nicht möglich, sodass die genaue Sicherheitenzuteilung möglicherweise nicht bekannt ist. In diesen Fällen sollten die Gegenparteien die Möglichkeit haben, Sicherheiten unabhängig vom zugrunde liegenden Kredit zu melden.
- (7) 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 ⁽³⁾ genannten Verfahren von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (8) Die ESMA hat zu diesem Entwurf offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme ihrer nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Zu meldende Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

- (1) Bei Meldungen gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2015/2365 sind die in den Tabellen 1, 2, 3 und 4 des Anhangs verlangten Einzelheiten der betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfte vollständig und genau zu übermitteln.
- (2) Bei Abschluss eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts geben die Gegenparteien in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Neu“ an. Bei nachfolgenden Meldungen von Einzelheiten dieses Wertpapierfinanzierungsgeschäfts wird in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs die jeweilige Art des Vorgangs angegeben.

Artikel 2

Von zentralen Gegenparteien gelearnte Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

- (1) Wird ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft, dessen Einzelheiten bereits gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2015/2365 gemeldet worden sind, anschließend durch eine zentrale Gegenpartei gelearnt, so wird dieses Geschäft nach erfolgtem Clearing in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs durch die Angabe „Kündigung/vorzeitige Kündigung“ als beendet gemeldet und werden die sich aus dem Clearing ergebenden neuen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemeldet.
- (2) An einem Handelsplatz geschlossene Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, die am selben Tag von einer zentralen Gegenpartei gelearnt werden, werden erst nach erfolgtem Clearing gemeldet.
- (3) Hat eine Gegenpartei für ein gelearntes Wertpapierfinanzierungsgeschäft Ein- oder Nachschusszahlungen hinterlegt oder erhalten, gibt sie die in Tabelle 3 des Anhangs genannten Einzelheiten sowie in Feld 20 dieser Tabelle die Art des Vorgangs an.

Artikel 3

Meldung von Sicherheiten

- (1) Gegenparteien von Wertpapier- oder Warenleih- oder -verleihgeschäften, die sich darauf einigen, dass keine Sicherheiten gestellt werden, geben dies in Tabelle 2 Feld 72 des Anhangs an.
- (2) Sind die Sicherheiten eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts an einen Einzelkredit geknüpft und sind der Gegenpartei bis zur Meldefrist die Einzelheiten der Sicherheiten bekannt, so gibt diese bei der ersten Meldung des betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfts in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Neu“ an und teilt in Tabelle 2 Felder 75 bis 94 des Anhangs die vollständigen und genauen Einzelheiten aller Sicherheitenkomponenten dieses Wertpapierfinanzierungsgeschäfts mit.

⁽³⁾ 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).

- (3) Sind die Sicherheiten eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts an einen Einzelkredit geknüpft, die Einzelheiten dieser Sicherheiten der Gegenpartei aber bis zur Meldefrist nicht bekannt, so gibt diese, sobald ihr die entsprechenden Einzelheiten bekannt sind, spätestens jedoch am Arbeitstag nach dem in Tabelle 2 Feld 13 des Anhangs angegebenen Valutierungstermin, in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Sicherheitenaktualisierung“ an und teilt in Tabelle 2 Felder 75 bis 94 des Anhangs die vollständigen und genauen Einzelheiten aller Sicherheitenkomponenten dieses Wertpapierfinanzierungsgeschäfts mit.
- (4) Gegenparteien, die ein oder mehrere Wertpapierfinanzierungsgeschäfte durch einen Sicherheitenkorb besichern, dem eine internationale Wertpapier-Identifikationsnummer („ISIN“) zugeordnet ist, geben bei der Meldung in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Neu“ und in Tabelle 2 Feld 96 des Anhangs die ISIN an.
- (5) Gegenparteien, die ein oder mehrere Wertpapierfinanzierungsgeschäfte durch einen Sicherheitenkorb besichern, dem keine ISIN zugeordnet ist, geben bei der Meldung in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Neu“ und in Tabelle 2 Feld 96 des Anhangs den Code „NTAV“ an.
- (6) Für die Zwecke der Absätze 4 und 5 geben die Gegenparteien, sobald ihnen die entsprechenden Einzelheiten bekannt sind, spätestens jedoch am Arbeitstag nach dem in Tabelle 2 Feld 13 des Anhangs angegebenen Valutierungstermin, in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Sicherheitenaktualisierung“ an und teilen in Tabelle 2 Felder 75 bis 94 des Anhangs die vollständigen und genauen Einzelheiten aller Sicherheitenkomponenten des betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfts mit.
- (7) Gegenparteien, die mehrere Wertpapierfinanzierungsgeschäfte auf Basis des Nettoforderungswerts besichern, geben in Tabelle 2 Feld 73 des Anhangs „zutreffend“ an. Die betreffenden Gegenparteien geben, sobald ihnen die entsprechenden Einzelheiten bekannt sind, spätestens jedoch am Arbeitstag nach dem in Tabelle 2 Feld 13 des Anhangs angegebenen Valutierungstermin, in Tabelle 2 Feld 98 des Anhangs „Sicherheitenaktualisierung“ an und teilen in Tabelle 2 Felder 75 bis 94 des Anhangs die vollständigen und genauen Einzelheiten zu allen Sicherheitenkomponenten der betreffenden Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mit.

Artikel 4

Meldung der Weiterverwendung von Sicherheiten

- (1) Gegenparteien, die bei einem Wertpapierfinanzierungsgeschäft ein oder mehrere Finanzinstrumente als Sicherheit erhalten, teilen in Tabelle 4 Felder 7, 8 und 9 des Anhangs die vollständigen und genauen Einzelheiten jeder Weiterverwendung dieser Finanzinstrumente mit.
- (2) Gegenparteien, die in einem Wertpapierfinanzierungsgeschäft Barmittel als Sicherheit erhalten, teilen in Tabelle 4 Felder 11, 12 und 13 des Anhangs für jede Währung die vollständigen und genauen Einzelheiten aller reinvestierten Barsicherheiten mit.

Artikel 5

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

Tabelle 1

Angaben zur Gegenpartei

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
1	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit der Übermittlung der Meldung an das Transaktionsregister.	Y	Y	Y	Y
2	Meldung einreichende Stelle	Einheitliche Kennziffer der die Meldung einreichenden Stelle. Wurde die Meldung einem Dritten oder der anderen Gegenpartei übertragen, Angabe einer einheitlichen Kennziffer für diese Stelle.	Y	Y	Y	Y
3	Meldende Gegenpartei	Einheitliche Kennziffer der meldenden Gegenpartei.	Y	Y	Y	Y
4	Art der meldenden Gegenpartei	Angabe, ob es sich bei der meldenden Gegenpartei um eine finanzielle oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei handelt.	Y	Y	Y	Y
5	Sektor der meldenden Gegenpartei	Ein oder mehrere Codes zur Kennzeichnung der Art der Geschäftstätigkeit der meldenden Gegenpartei. Wenn es sich bei der meldenden Gegenpartei um eine finanzielle Gegenpartei handelt, Angabe aller relevanten Codes, die in der Taxonomie für finanzielle Gegenparteien enthalten sind und auf die betreffende Gegenpartei zutreffen. Wenn es sich bei der meldenden Gegenpartei um eine nichtfinanzielle Gegenpartei handelt, Angabe aller relevanten Codes, die in der Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien enthalten sind und auf die betreffende Gegenpartei zutreffen. Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, so sind die Codes in der Reihenfolge der Bedeutung der jeweiligen Tätigkeit einzufügen.	Y	Y	Y	Y
6	Zusätzliche Sektorklassifizierung	Wenn es sich bei der meldenden Gegenpartei um Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) oder Verwalter alternativer Investmentfonds handelt, ist mit dem Code anzugeben, ob dies börsenhandelte Fonds (ETF) oder Geldmarktfonds (MMF) sind. Wenn es sich bei der meldenden Gegenpartei um alternative Investmentfonds oder nichtfinanzielle Gegenparteien handelt, die Finanz- und Versicherungsdienstleistungen erbringen oder im Grundstücks- und Wohnungswesen tätig sind, ist mit dem Code anzugeben, ob dies Immobilieninvestmentfonds (REIT) sind.	Y	Y	Y	Y
7	Zweigniederlassung der meldenden Gegenpartei	Wenn die meldende Gegenpartei ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft („SFT“) über eine Zweigniederlassung abschließt, ist der Code zur Identifizierung der Zweigniederlassung anzugeben.	Y	Y	Y	Y
8	Zweigniederlassung der anderen Gegenpartei	Wenn die andere Gegenpartei ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft („SFT“) über eine Zweigniederlassung abschließt, ist der Code zur Identifizierung der Zweigniederlassung anzugeben.	Y	Y	Y	Y

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
9	Seite der Gegenpartei	Angabe, ob es sich bei der meldenden Gegenpartei um einen Sicherungsgeber oder einen Sicherungsnehmer gemäß Artikel 4 der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 der Kommission ⁽¹⁾ handelt.	Y	Y	Y	Y
10	Für die Meldung zuständige Stelle	Obliegt einer finanziellen Gegenpartei gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ die Verantwortung für die Meldung im Namen der anderen Gegenpartei, so ist die einheitliche Kennziffer der finanziellen Gegenpartei einzufügen. Obliegt einer Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 4 Absatz 3 der genannten Verordnung die Verantwortung für die Meldung im Namen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW), so ist die einheitliche Kennziffer der Verwaltungsgesellschaft einzufügen. Obliegt einem Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen eines alternativen Investmentfonds, so ist die einheitliche Kennziffer des AIFM einzufügen.	Y	Y	Y	Y
11	Andere Gegenpartei	Einheitliche Kennziffer des Unternehmens, mit dem die meldende Gegenpartei das SFT geschlossen hat. Für Privatpersonen wird durchgängig eine Kundenkennziffer angegeben.	Y	Y	Y	Y
12	Land der anderen Gegenpartei	Code des Landes, in dem sich der eingetragene Geschäftssitz der anderen Gegenpartei befindet, oder des Wohnsitzlandes, wenn die andere Gegenpartei eine natürliche Person ist.	Y	Y	Y	Y
13	Begünstigter	Ist der Begünstigte nicht Gegenpartei des Kontrakts, muss die meldende Gegenpartei diesen Begünstigten mittels einer einheitlichen Kennziffer oder im Falle von Privatpersonen mittels der durchgängig verwendeten Kundenkennziffer, den die von der Privatperson genutzte Rechtsform zugeteilt hat, angeben.	Y	Y	Y	N
14	Tri-Party-Agent	Einheitliche Kennziffer des Dritten, dem die meldende Gegenpartei die Nachhandelsphase eines SFT übertragen hat (falls zutreffend).	Y	Y	Y	N
15	Makler	Einheitliche Kennziffer des Unternehmens, das als Mittler für die meldende Gegenpartei fungiert, ohne selbst Gegenpartei des SFT zu werden. Bei Wertpapierleihgeschäften wird die Leihstelle nicht als Makler betrachtet.	Y	Y	Y	N

⁽¹⁾ 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).

⁽²⁾ 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).

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
16	Clearingmitglied	Wenn das Geschäft gecleart wird, einheitliche Kennziffer des zuständigen Clearingmitglieds der meldenden Gegenpartei.	Y	Y	Y	N
17	Teilnehmender Zentralverwahrer oder indirekter Teilnehmer	Einheitliche Kennziffer des teilnehmenden Zentralverwahrers oder des indirekten Teilnehmers der meldenden Gegenpartei. Sind sowohl der teilnehmende Zentralverwahrer als auch der indirekte Teilnehmer am Geschäft beteiligt, ist die Kennziffer des indirekten Teilnehmers einzufügen. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	N
18	Leihstelle	Einheitliche Kennziffer der am Wertpapierleihgeschäft beteiligten Leihstelle.	Y	N	Y	N

Tabelle 2

Kredite und Sicherheiten

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
1	Eindeutige Transaktionskennung (UTI)	Dem SFT eindeutig zugewiesene Kennung zur Identifizierung des Geschäfts.	Y	Y	Y	Y
2	Laufende Meldenummer	Im Falle von Geschäften, die sich aus dem Clearing ergeben, wird die vorherige UTI, d. h. die UTI des ursprünglichen bilateralen Geschäfts, eingefügt. Die vorherige UTI braucht jedoch nicht für Gegenparteien gemeldet zu werden, die das SFT als zentrale Gegenpartei („CCP“) gecleart haben. Wurde ein SFT an einem Handelsplatz ausgeführt und am gleichen Tag gecleart, so ist eine vom Handelsplatz generierte eindeutige Nummer für dieses Geschäft einzufügen.	Y	Y	Y	N
3	Datum des Ereignisses	Datum, an dem das meldepflichtige, durch die Meldung erfasste Ereignis im Zusammenhang mit dem SFT eingetreten ist. Bei den Maßnahmenarten „Valuation update“ (Bewertungsaktualisierung), „Collateral update“ (Sicherheitenaktualisierung), „Reuse update“ (Aktualisierung der Weiterverwendung) und „Margin update“ (Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen) ist das Datum einzufügen, zu dem die gemeldeten Informationen bereitgestellt werden.	Y	Y	Y	Y
4	Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts	Art des SFT-Geschäfts gemäß Artikel 3 Absätze 7 bis 10 der Verordnung (EU) 2015/2365.	Y	Y	Y	Y
5	Gecleart	Angabe, ob ein zentrales Clearing stattgefunden hat.	Y	Y	Y	N
6	Clearing Zeitstempel	Uhrzeit und Datum des Clearing.	Y	Y	Y	N
7	CCP	Bei geclearten Kontrakten Angabe der einheitlichen Kennziffer der CCP, die den Kontrakt gecleart hat.	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
8	Handelsplatz	Einheitliche Kennziffer des Ausführungsplatzes des SFT. Bei außerbörslich getätigten SFT, die für den Handel zugelassen werden, ist der MIC-Code „XOFF“ anzugeben. Bei außerbörslich getätigten SFT, die nicht für den Handel zugelassen werden, ist der MIC-Code „XXXX“ anzugeben.	Y	Y	Y	N
9	Art des Rahmenvertrags	Angabe der Art des Rahmenvertrags, unter dem die Gegenparteien ein SFT geschlossen haben.	Y	Y	Y	N
10	Andere Art des Rahmenvertrags	Bezeichnung des Rahmenvertrags. Dieses Feld ist nur auszufüllen, wenn in Feld 9 „OTHR“ angegeben wurde.	Y	Y	Y	N
11	Rahmenvertrag Version	Gegebenenfalls Angabe des Jahres des für das gemeldete Geschäft relevanten Rahmenvertrags.	Y	Y	Y	N
12	Ausführung Zeitstempel	Datum und Uhrzeit der Ausführung des SFT.	Y	Y	Y	Y
13	Valutierungstermin (Anfangstermin)	Vertraglich zwischen den Gegenparteien vereinbarter Zeitpunkt für den Tausch von Barmitteln, Wertpapieren oder Waren gegen Sicherheiten für die Eröffnung (Kassaposition) des SFT.	Y	Y	Y	N
14	Fälligkeitsdatum (Endtermin)	Vertraglich zwischen den Gegenparteien vereinbarter Zeitpunkt für den Tausch von Barmitteln, Wertpapieren oder Waren gegen Sicherheiten für die Schließung (Terminseite) des SFT. Bei unbefristetem Repo-Geschäften sind diese Angaben nicht erforderlich.	Y	Y	Y	N
15	Kontraktende	Bei vollständiger vorzeitiger Beendigung des SFT ist hier das Datum des Kontraktendes anzugeben.	Y	Y	Y	Y
16	Mindestkündigungsfrist	Mindestanzahl der Geschäftstage, innerhalb deren eine der Gegenparteien die andere Gegenpartei im Voraus über die Beendigung des Geschäfts informieren muss.	Y	N	N	N
17	Frühester Call-back-Termin	Frühestmöglicher Zeitpunkt, zu dem der Kreditgeber das Recht zum teilweisen Call-back von Mitteln oder Zeitraum Beendigung des Geschäfts hat.	Y	N	N	N
18	Allgemeiner Sicherheitenindikator	Angabe, ob für das SFT eine allgemeine Sicherheitenvereinbarung getroffen wurde. Bei Wertpapierleihgeschäften werden in diesem Feld die als Sicherheiten hinterlegten Wertpapiere, nicht aber die geliehenen Wertpapiere angegeben.	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
		<p>Der Code „GENE“ wird bei SFT angegeben, für die eine allgemeine Sicherungsvereinbarung geschlossen wurde. Bei einer allgemeinen Sicherungsvereinbarung kann der Sicherungsgeber das als Sicherheit zu hinterlegende Wertpapier aus einer relativ breiten Palette von Wertpapieren auswählen, die vorab festgelegte Kriterien erfüllen.</p> <p>Der Code „SPEC“ wird bei SFT angegeben, für die eine spezifische Sicherungsvereinbarung geschlossen wurde. Bei einer spezifischen Sicherungsvereinbarung verlangt der Sicherungsnehmer vom Sicherungsgeber die Bereitstellung einer spezifischen internationalen Wertpapier-Identifikationsnummer („ISIN“).</p>				
19	DBV-Indikator (DBV = Delivery By Value)	Angabe, ob das Geschäft mittels des DBV-Mechanismus abgewickelt wurde.	Y	N	Y	N
20	Methode, nach der Sicherheiten bereitgestellt werden	<p>Angabe, ob die Sicherheiten eines SFT in Form der Vollrechtsübertragung, als Finanzsicherheit in Form eines beschränkten dinglichen Rechts oder als Finanzsicherheiten mit Nutzungsrecht gestellt werden.</p> <p>Werden bei der Stellung von Sicherheiten mehrere Methoden genutzt, so ist in diesem Feld die primäre Sicherheitenvereinbarung anzugeben.</p>	Y	N	Y	Y
21	Unbefristet	<p>Angabe, ob es sich bei dem SFT um ein unbefristetes Geschäft (ohne festen Fälligkeitstermin) oder ein befristetes Geschäft mit vertraglich vereinbartem Fälligkeitstermin handelt.</p> <p>Bei unbefristeten SFT wird der Code „True“ (zutreffend), bei befristeten SFT der Code „False“ (nicht zutreffend) angegeben.</p>	Y	N	Y	N
22	Optionale Kündigung	Angabe, ob das SFT unbegrenzt oder verlängerbar ist.	Y	N	Y	N

Bei Lombardkrediten sind die Felder 23 bis 34 für jede Währung, die im Lombardkredit verwendet wird, auszufüllen.

23	Festsatz	<p>Bei Repo-Geschäften ist der annualisierte Zinssatz auf den Kapitalbetrag des Pensionsgeschäfts gemäß den Zinsberechnungsmethoden anzugeben.</p> <p>Bei Lombardkrediten ist der annualisierte Zinssatz auf den Kreditbetrag anzugeben, den der Kreditnehmer an den Kreditgeber zahlt.</p>	Y	N	N	Y
----	----------	---	---	---	---	---

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
24	Zinsberechnungsmethode	Methode zur Berechnung der auf den Kapitalbetrag aufgelaufenen Zinsen für einen Zinssatz.	Y	N	N	Y
25	Variabler Zinssatz	Angabe des verwendeten Referenzzinssatzes, der in im Voraus festgelegten Zeitabständen unter Bezugnahme auf einen marktüblichen Referenzzinssatz neu festgesetzt wird, sofern anwendbar.	Y	N	N	Y
26	Referenzzeitraum für variablen Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung des Referenzzeitraums der variablen Seite.	Y	N	N	Y
27	Referenzzeitraum für variablen Satz — Multiplikator	Multiplikator des in Feld 26 angegebenen Zeitraums zur Beschreibung des Referenzzeitraums der variablen Seite.	Y	N	N	Y
28	Zahlungshäufigkeit variabler Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung der Zahlungshäufigkeit des variablen Satzes.	Y	N	N	Y
29	Zahlungshäufigkeit variabler Satz — Multiplikator	Multiplikator für den in Feld 28 angegebenen Zeitraum zur Beschreibung der Zahlungshäufigkeit des variablen Satzes.	Y	N	N	Y
30	Anpassungshäufigkeit variabler Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung der Anpassungshäufigkeit des variablen Satzes.	Y	N	N	Y
31	Anpassungshäufigkeit variabler Satz — Multiplikator	Multiplikator für den in Feld 30 angegebenen Zeitraum zur Beschreibung der Anpassungshäufigkeit des variablen Satzes.	Y	N	N	Y
32	Spread	Anzahl der Basispunkte, die zur Ermittlung des Zinssatzes des Kredits zum variablen Zinssatz zu addieren oder von diesem abzuziehen sind.	Y	N	N	Y
33	Währungsbetrag Lombardkredite	Betrag eines Lombardkredits in einer bestimmten Währung.	N	N	N	Y
34	Währung Lombardkredite	Währung des Lombardkredits.	N	N	N	Y

Die Felder 35 und 36 sind bei jeder Anpassung des variablen Satzes erneut auszufüllen.

35	Angepasster Satz	Satz gemäß dem entsprechendem Zinssatzplan.	Y	N	N	N
----	------------------	---	---	---	---	---

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
36	Datum Zinssatz	Datum, ab dem der Zinssatz wirksam ist.	Y	N	N	N
37	Kapitalbetrag am Valutierungstermin	Zum Valutierungstermin des Geschäfts fälliger Barbetrag.	Y	Y	N	N
38	Kapitalbetrag am Fälligkeitstermin	Zum Fälligkeitstermin des Geschäfts zu zahlender Barbetrag.	Y	Y	N	N
39	Währung Kapitalbetrag	Währung des Kapitalbetrags.	Y	Y	N	N
40	Art des Vermögenswerts	Angabe der Art des Vermögenswerts, der Gegenstand des SFT ist.	N	N	Y	N
41	Wertpapierkennung	Angabe des Wertpapiers, das Gegenstand des SFT ist. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N
42	Wertpapierklassifizierung	„CFI-Code“ (Code zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten) des Wertpapiers, das Gegenstand des SFT ist. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N

Wurde eine Ware verliehen oder entliehen, so ist die Klassifizierung dieser Ware in den Feldern 43, 44 und 45 anzugeben.

43	Zugrunde liegendes Produkt	Zugrunde liegendes Produkt gemäß der Klassifizierung von Waren in Tabelle 5 von Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363.	N	N	Y	N
44	Unterprodukt	Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Waren in Tabelle 5 von Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363. Dieses Feld erfordert die Angabe eines spezifischen zugrunde liegenden Produkts in Feld 43.	N	N	Y	N
45	Weiteres Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Waren. Dieses Feld erfordert die Angabe eines spezifischen Unterprodukts in Feld 44.	N	N	Y	N
46	Anzahl/Menge oder Nominalbetrag	Anzahl/Menge oder Nominalbetrag des Wertpapiers oder der Ware, das/die Gegenstand des SFT ist. Im Falle von Schuldverschreibungen Angabe des nominalen Gesamtbetrags, d. h. Anzahl der Schuldverschreibungen, multipliziert mit ihrem Nennwert. Im Falle anderer Wertpapiere oder Waren Angabe der Anzahl/Menge.	N	N	Y	N
47	Maßeinheit	Maßeinheit, in der die Menge angegeben ist. Dieses Feld ist bei Waren auszufüllen.	N	N	Y	N
48	Währung des Nominalbetrags	Bei Meldung des Nominalbetrags Angabe der Währung des Nominalbetrags.	N	N	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
49	Wertpapier- oder Rohstoffpreis	Bei Wertpapier- und Warenverleih- und -leihgeschäften Angabe des Preises des Wertpapiers oder der Ware, der bei der Berechnung des Kreditwertes verwendet wurde. Bei „Buy-sell back“-Geschäften Angabe des Preises des Wertpapiers oder der Ware, der bei der Berechnung des Handelsbetrags für die Kassaposition des Geschäfts verwendet wurde.	N	Y	Y	N
50	Währung des Preises	Währung, auf die der Wertpapier- oder Warenpreis lautet.	N	N	Y	N
51	Wertpapierqualität	Code zur Klassifizierung des Kreditrisikos des Wertpapiers.	N	N	Y	N
52	Fälligkeit des Wertpapiers	Fälligkeit des Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N
53	Land des Emittenten	Land des Wertpapieremittenten. Bei Wertpapieren, die von einem ausländischen Tochterunternehmen begeben werden, Angabe des Landes des obersten Mutterunternehmens oder, falls dieses nicht bekannt ist, des Tochterunternehmens. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N
54	LEI des Emittenten	LEI des Emittenten des Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N
55	Art des Wertpapiers	Code zur Klassifizierung der Art des Wertpapiers.	N	N	Y	N
56	Kreditbetrag	Kreditbetrag, d. h. Anzahl oder Nominalbetrag der Kredite, multipliziert mit dem in Feld 49 angegebenen Preis.	N	N	Y	N
57	Marktwert	Marktwert der verliehenen oder entliehenen Wertpapiere oder Waren.	N	N	Y	N
58	Verbilligter Satz (fest)	Angabe des festen Zinssatzes (vereinbarter Satz, den der Verleiher bei Reinvestition der Barsicherheiten, abzüglich etwaiger Leihgebühren, zahlt); dieser Satz wird vom Verleiher des Wertpapiers oder der Ware an den Entleiher (positiver verbilligter Satz) oder vom Entleiher an den Verleiher (negativer verbilligter Satz) auf den Saldo der gestellten Barsicherheiten gezahlt.	N	N	Y	N
59	Verbilligter Satz (variabel)	Angabe des Referenzzinssatzes, der zur Berechnung des verbilligten Satzes verwendet wurde (vereinbarter Satz, den der Verleiher bei Reinvestition der Barsicherheiten, abzüglich etwaiger Leihgebühren, zahlt); dieser Satz wird vom Verleiher des Wertpapiers oder der Ware an den Entleiher (positiver verbilligter Satz) oder vom Entleiher an den Verleiher (negativer verbilligter Satz) auf den Saldo der gestellten Barsicherheiten gezahlt.	N	N	Y	N
60	Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung des Referenzzeitraums des verbilligten Satzes.	N	N	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
61	Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Multiplikator	Multiplikator des in Feld 60 angegebenen Zeitraums zur Beschreibung des Referenzzeitraums des verbilligten Satzes.	N	N	Y	N
62	Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung der Zahlungshäufigkeit des variablen verbilligten Satzes.	N	N	Y	N
63	Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Multiplikator	Multiplikator für den in Feld 62 angegebenen Zeitraum zur Beschreibung der Zahlungshäufigkeit des variablen verbilligten Satzes.	N	N	Y	N
64	Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Zeitraum	Zeitraum zur Beschreibung der Anpassungshäufigkeit des variablen verbilligten Satzes.	N	N	Y	N
65	Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz — Multiplikator	Multiplikator für den in Feld 64 angegebenen Zeitraum zur Beschreibung der Anpassungshäufigkeit des variablen verbilligten Satzes.	N	N	Y	N
66	Spread des verbilligten Satzes	Spread des variablen verbilligten Satzes in Basispunkten.	N	N	Y	N
67	Leihgebühr	Gebühr, die der Entleiher des Wertpapiers oder der Ware an den Verleiher zahlt.	N	N	Y	N
68	Ausschließlichkeitsvereinbarungen	Bei Wertpapierleih- und -verleihgeschäften Angabe, ob der Entleiher diesbezüglich exklusiven Zugang auf das Wertpapierportfolio des Verleihers hat. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	N	N	Y	N
69	Ausstehender Lombardkredit	Gesamtbetrag von Lombardkrediten in der Basiswährung.	N	N	N	Y
70	Basiswährung des ausstehenden Lombardkredits	Basiswährung des ausstehenden Lombardkredits.	N	N	N	Y
71	Marktwert von Short-Positionen	Marktwert der Short-Position in der Basiswährung.	N	N	N	Y

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
Sicherheiten						
72	Signalisierung eines unbesicherten Wertpapierleihgeschäfts („SL“, Securities Lending)	Angabe, ob das SFT unbesichert ist. Dieses Feld ist nicht auszufüllen, wenn die Gegenparteien zwar eine Besicherung des Geschäfts beschließen, die spezifische Verteilung der Sicherheiten aber noch nicht bekannt ist.	N	N	Y	N
73	Besicherung des Nettoforderungswerts	Angabe, ob die Sicherheit nicht für ein einziges Geschäft, sondern vielmehr für einen Nettoforderungswert gestellt wurde.	Y	Y	Y	N
74	Valutierungstermin der Sicherheit(en)	Bei Geschäften, die nicht auf Basis des Nettoforderungswerts besichert sind, Angabe des jüngsten Valutierungstermins im Netting-Satz der SFT unter Berücksichtigung aller Geschäfte, für die die Sicherheit geleistet wurde.	Y	Y	Y	N

Bei Verwendung spezifischer Sicherheiten sind die Felder 75 bis 94, sofern zutreffend, für jede Sicherheitenkomponente auszufüllen.

75	Art der Sicherheitenkomponente	Angabe der Art der Sicherheitenkomponente.	Y	Y	Y	Y
----	--------------------------------	--	---	---	---	---

Haben Barmittel als Sicherheit gedient, so ist dies in den Feldern 76 und 77 anzugeben.

76	Höhe Barsicherheit(en)	Höhe der als Sicherheit für die Wertpapier- oder Warenleihe bereitgestellten Mittel.	Y	Y	Y	N
77	Währung Barsicherheit(en)	Währung der Barsicherheiten.	Y	Y	Y	N
78	Kennung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers	Kennung des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	Y
79	Klassifizierung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers	CFI-Code des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	Y

Hat eine Ware als Sicherheit gedient, so ist die Klassifizierung dieser Ware in den Feldern 80, 81 und 82 anzugeben.

80	Zugrunde liegendes Produkt	Zugrunde liegendes Produkt gemäß der Klassifizierung von Waren in Tabelle 5 von Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363.	Y	Y	Y	N
81	Unterprodukt	Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Waren in Tabelle 5 von Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363. Dieses Feld erfordert die Angabe eines spezifischen zugrunde liegenden Produkts in Feld 80.	Y	Y	Y	N
82	Weiteres Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Waren in Tabelle 5 von Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2019/363. Dieses Feld erfordert die Angabe eines spezifischen Unterprodukts in Feld 81.	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
83	Anzahl/Menge oder Nominalbetrag der Sicherheiten	Anzahl/Menge oder Nominalbetrag des Wertpapiers oder der Ware, das/die Gegenstand des SFT ist. Im Falle von Schuldverschreibungen Angabe des gesamten Nominalbetrags, d. h. Anzahl der Schuldverschreibungen, multipliziert mit ihrem Nennwert. Im Falle anderer Wertpapiere oder Waren Angabe der Anzahl/Menge.	Y	Y	Y	Y
84	Maßeinheit der Sicherheit(en)	Maßeinheit, in der die Menge angegeben ist. Dieses Feld ist bei Waren auszufüllen.	Y	Y	Y	N
85	Währung des Nominalbetrags der Sicherheit(en)	Bei Meldung des Nominalbetrags der Sicherheiten Angabe der Währung des Nominalbetrags.	Y	Y	Y	Y
86	Währung des Preises	Währung des Preises der Sicherheitenkomponente.	Y	Y	Y	Y
87	Preis pro Stück	Preis pro Stück in Bezug auf die Sicherheitenkomponente einschließlich aufgelaufener Zinsen für verzinsliche Wertpapiere, die zur Bezifferung des Wertes der Sicherheit oder der Ware verwendet werden.	Y	Y	Y	Y
88	Marktwert der Sicherheit(en)	Marktwert der einzelnen Sicherheitenkomponenten in der Währung des Preises.	Y	Y	Y	Y
89	Abschlag oder Spanne	Bei Repogeschäften und „Buy-sell back“-Geschäften werden Sicherheitenabschläge unter Bezugnahme auf jegliche bezüglich der zugrunde liegenden Sicherheit angewandten Risikokontrollmaßnahmen auf ISIN-Ebene angegeben, wobei der Wert der zugrunde liegenden Sicherheit als der um einen bestimmten Prozentsatz verminderte Marktwert der Vermögenswerte berechnet wird. Bei Wertpapierleihgeschäften wird der Prozentsatz von Sicherheitenabschlägen unter Bezugnahme auf jegliche bezüglich der zugrunde liegenden Sicherheit angewandten Risikokontrollmaßnahmen entweder auf ISIN- oder auf Portfolioebene angegeben, wobei der Wert der zugrunde liegenden Sicherheit als der um einen bestimmten Prozentsatz verminderte Marktwert der Vermögenswerte berechnet wird. Bei Lombardkrediten Angabe des Prozentsatzes der Ein-/Nachschussanforderung, der auf das gesamte im Primebroker-Konto eines Kunden gehaltene Sicherheitenportfolio angewandt wird. In diesem Feld sind keine Schätz- oder Standardwerte, sondern tatsächliche Werte anzugeben.	Y	Y	Y	Y
90	Qualität der Sicherheit(en)	Code zur Klassifizierung der Risikos des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers.	Y	Y	Y	Y
91	Fälligkeitsdatum des Wertpapiers	Fälligkeitsdatum des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	Y

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
92	Land des Emittenten	Land des Emittenten des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers. Bei Wertpapieren, die von einem ausländischen Tochterunternehmen begeben werden, ist das Land des obersten Mutterunternehmens zu melden oder, falls dieses nicht bekannt ist, das Land des Tochterunternehmens. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	Y
93	LEI des Emittenten	LEI des Emittenten des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers. Bei Waren ist in diesem Feld keine Angabe erforderlich.	Y	Y	Y	Y
94	Art der Sicherheit(en)	Code zur Klassifizierung der Art des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers.				
95	Möglichkeit der Weiterverwendung einer Sicherheit	Angabe, ob der Sicherungsnehmer die als Sicherheit gestellten Wertpapiere weiterverwenden kann.	Y	Y	Y	Y

Wurde ein Sicherheitenkorb genutzt, so ist dies in Feld 96 entsprechend anzugeben. Sofern verfügbar, ist die detaillierte Verteilung der Sicherheiten für SFT, die gegen einen Sicherheitenpool getätigt werden, in den Feldern 75 bis 94 anzugeben.

96	Kennung Sicherheitenkorb	Wenn der Sicherheitenkorb durch eine ISIN gekennzeichnet werden kann, Angabe der ISIN des Sicherheitenkorbs. Wenn der Sicherheitenkorb nicht durch eine ISIN gekennzeichnet werden kann, ist in diesem Feld „NTAV“ anzugeben.	Y	Y	Y	N
97	Portfolio-Code	Wird das Geschäft geleast und in ein Portfolio der Geschäfte aufgenommen, für die Einschuss-/Nachschusszahlungen geleistet werden, ist das Portfolio mittels einer eindeutigen, von der meldenden Gegenpartei festgelegten Kennziffer zu kennzeichnen. Umfasst das Portfolio auch Derivatekontrakte, die gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 meldepflichtig sind, ist der gleiche Portfolio-Code anzugeben wie bei der Meldung gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012.	Y	Y	Y	N
98	Art des Vorgangs	In der Meldung sind folgende Arten von Vorgängen anzugeben: (a) Bei einem erstmalig gemeldeten SFT erfolgt die Angabe „New“ (neu); (b) bei Änderungen der Einzelheiten eines bereits gemeldeten SFT erfolgt die Angabe „Modification“ (Änderung). Darunter fällt auch die Aktualisierung einer bestehenden Meldung, die eine Position aufführt, um neuen, in dieser Position enthaltenen Geschäften Rechnung zu tragen; (c) bei der Bewertung von Wertpapieren oder Waren, die Gegenstand von Wertpapier- oder Warenverleihgeschäften sind, erfolgt die Angabe „Valuation Update“ (Bewertungsaktualisierung);	Y	Y	Y	Y

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
		<p>(d) bei Änderungen der Einzelheiten von Sicherheiten, einschließlich ihrer Bewertung, erfolgt die Angabe „Collateral update“ (Aktualisierung der Sicherheiten);</p> <p>(e) bei Stornierung einer fehlerhaft eingereichten Meldung, d. h. im Falle, dass ein SFT nie zustande kam oder nicht unter die Meldepflicht fiel, aber fälschlicherweise doch an ein Transaktionsregister gemeldet wurde, erfolgt die Angabe: „Error“ (Fehler);</p> <p>(d) bei Berichtigung von Datenfeldern, die in einer früheren Meldung falsch ausgefüllt wurden, erfolgt die Angabe „Correction“ (Korrektur);</p> <p>(g) bei Kündigung eines unbefristeten SFT oder der vorzeitigen Kündigung eines befristeten SFT erfolgt die Angabe „Termination/Early termination“ (Kündigung/vorzeitige Kündigung);</p> <p>(h) bei SFT, die als neues Geschäft gemeldet werden müssen und am selben Tag auch in einer separaten Positionsmeldung aufgeführt werden, erfolgt die Angabe: „position component“ (Positionskomponente).</p>				
99	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 Geschäftsebene erfolgen, um Nachhandelsereignisse zu melden, und ist auf Fälle beschränkt, in denen die individuellen Geschäfte mit fungiblen Produkten durch die Position ersetzt wurden.</p>	Y	Y	Y	N

Tabelle 3

Angaben zu Einschuss-/Nachschusszahlungen

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
1	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit der Übermittlung der Meldung an das Transaktionsregister.	Y	Y	Y	N
2	Datum des Ereignisses	Datum, an dem das meldepflichtige, durch die Meldung erfasste Ereignis im Zusammenhang mit dem SFT eingetreten ist. Bei den Maßnahmenarten „Valuation update“ (Bewertungsaktualisierung), „Collateral update“ (Sicherheitenaktualisierung), „Reuse update“ (Aktualisierung der Weiterverwendung) und „Margin update“ (Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen) ist das Datum einzufügen, zu dem die gemeldeten Informationen bereitgestellt werden.	Y	Y	Y	N
3	Meldung einreichende Stelle	Einheitliche Kennziffer der die Meldung einreichenden Stelle. Wurde die Meldung einem Dritten oder der anderen Gegenpartei übertragen, Angabe einer einheitlichen Kennziffer für diese Stelle.	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
4	Meldende Gegenpartei	Einheitliche Kennziffer der meldenden Gegenpartei.	Y	Y	Y	N
5	Für die Meldung zuständige Stelle	<p>Obliegt einer finanziellen Gegenpartei gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen der anderen Gegenpartei, so ist die einheitliche Kennziffer der finanziellen Gegenpartei einzufügen.</p> <p>Obliegt einer Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW), so ist die einheitliche Kennziffer der Verwaltungsgesellschaft einzufügen.</p> <p>Obliegt einem Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen eines alternativen Investmentfonds, so ist die einheitliche Kennziffer des AIFM einzufügen.</p>	Y	Y	Y	Y
6	Andere Gegenpartei	Einheitliche Kennziffer des Unternehmens, mit dem die meldende Gegenpartei das SFT geschlossen hat.	Y	Y	Y	N
7	Portfolio-Code	<p>Das Portfolio der Geschäfte, für die Einschuss-/Nachschusszahlungen geleistet werden, ist mittels einer eindeutigen, von der meldenden Gegenpartei festgelegten Kennziffer anzugeben.</p> <p>Umfasst das Portfolio auch Derivatekontrakte, die gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 meldepflichtig sind, ist der gleiche Portfolio-Code anzugeben wie bei der Meldung gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012.</p>	Y	Y	Y	N
8	Hinterlegte Ersteinschusszahlung	<p>Wert des Ersteinschusses, der von der meldenden Gegenpartei für die andere Gegenpartei bereitgestellt wurde.</p> <p>Erfolgt der Ersteinschuss auf Portfoliobasis, ist in diesem Feld der Wert des für das Portfolio insgesamt hinterlegten Ersteinschusses anzugeben.</p>	Y	Y	Y	N
9	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung.	Y	Y	Y	N
10	Hinterlegte Nachschusszahlung	<p>Wert des Nachschusses, einschließlich des Wertes von Barmitteln, der von der meldenden Gegenpartei für die andere Gegenpartei bereitgestellt wurde.</p> <p>Erfolgt die Nachschussleistung auf Portfoliobasis, ist in diesem Feld der Wert der für das Portfolio insgesamt hinterlegten Nachschüsse anzugeben.</p>	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
11	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung.	Y	Y	Y	N
12	Erhaltene Ersteinschusszahlung	Wert des Ersteinschusses, den die meldende Gegenpartei von der anderen Gegenpartei erhalten hat. Erfolgt der Ersteinschuss auf Portfoliobasis, ist in diesem Feld der Wert des für das Portfolio insgesamt erhaltenen Ersteinschusses anzugeben.	Y	Y	Y	N
13	Währung der erhaltenen Ersteinschusszahlung	Währung der erhaltenen Ersteinschusszahlung.	Y	Y	Y	N
14	Erhaltene Nachschusszahlung	Wert des erhaltenen Nachschusses, einschließlich des Wertes von Barmitteln, der von der meldenden Gegenpartei für die andere Gegenpartei bereitgestellt wurde. Erfolgt die Nachschusszahlung auf Portfoliobasis, ist in diesem Feld der Wert des für das Portfolio insgesamt erhaltenen Nachschusszahlungen anzugeben.	Y	Y	Y	N
15	Währung der erhaltenen Nachschusszahlung	Währung der erhaltenen Nachschusszahlung.	Y	Y	Y	N
16	Hinterlegte überschüssige Sicherheiten	Wert der über die erforderlichen Sicherheiten hinausgehenden hinterlegten Sicherheiten.	Y	Y	Y	N
17	Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten	Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten.	Y	Y	Y	N
18	Erhaltene überschüssige Sicherheiten	Wert der über die erforderlichen Sicherheiten hinausgehenden erhaltenen Sicherheiten.	Y	Y	Y	N
19	Währung der erhaltenen überschüssigen Sicherheiten	Währung der erhaltenen überschüssigen Sicherheiten.	Y	Y	Y	N
20	Art des Vorgangs	In der Meldung sind folgende Arten von Vorgängen anzugeben: (a) Bei neuem Einschuss-/Nachschussaldo erfolgt die Angabe „neu“; (b) bei Änderungen der Einzelheiten der Einschuss-/Nachschusszahlungen erfolgt die Angabe „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen“;	Y	Y	Y	N

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
		c) bei Stornierung einer fehlerhaft eingereichten Meldung erfolgt die Angabe „Fehler“; (d) bei Berichtigung von Datenfeldern, die in einer früheren Meldung falsch ausgefüllt wurden, erfolgt die Angabe „Korrektur“.				

Tabelle 4

Weiterverwendung, reinvestierte Barmittel und Finanzierungsquellen

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
1	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit der Übermittlung der Meldung an das Transaktionsregister.	Y	Y	Y	Y
2	Datum des Ereignisses	Datum, an dem das meldepflichtige, durch die Meldung erfasste Ereignis im Zusammenhang mit dem SFT eingetreten ist. Bei den Maßnahmenarten „Valuation update“ (Bewertungsaktualisierung), „Collateral update“ (Sicherheitenaktualisierung), „Reuse update“ (Aktualisierung der Weiterverwendung) und „Margin update“ (Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen) ist das Datum einzufügen, zu dem die gemeldeten Informationen bereitgestellt werden.	Y	Y	Y	Y
3	Meldung einreichende Stelle	Einheitliche Kennziffer der die Meldung einreichenden Stelle. Wurde die Meldung einem Dritten oder der anderen Gegenpartei übertragen, Angabe einer einheitlichen Kennziffer für diese Stelle.	Y	Y	Y	Y
4	Meldende Gegenpartei	Einheitliche Kennziffer der meldenden Gegenpartei.	Y	Y	Y	Y
5	Für die Meldung zuständige Stelle	Obliegt einer finanziellen Gegenpartei gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/ 2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen der anderen Gegenpartei, so ist die einheitliche Kennziffer der finanziellen Gegenpartei einzufügen. Obliegt einer Verwaltungsgesellschaft gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW), so ist die einheitliche Kennziffer der Verwaltungsgesellschaft einzufügen. Obliegt einem Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) gemäß Artikel 4 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2015/2365 die Verantwortung für die Meldung im Namen eines alternativen Investmentfonds, so ist die einheitliche Kennziffer des AIFM einzufügen.	Y	Y	Y	Y

Feld 6 ist für jede Sicherheitenkomponente auszufüllen.

6	Art der Sicherheitenkomponente	Angabe der Art der Sicherheitenkomponente.	Y	Y	Y	Y
---	--------------------------------	--	---	---	---	---

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
-----	------	---------------------	------	-----	----	----

Die Felder 7, 8, 9 und 10 sind für jede Sicherheit auszufüllen.

7	Sicherheitenkomponente	Kennung des als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers.	Y	Y	Y	Y
8	Wert weiterverwendeter Sicherheiten	Gesamtwert der weiterverwendeten Sicherheiten, wenn dieser auf der Ebene des SFT berechnet werden kann.	Y	Y	Y	Y
9	Geschätzte Weiterverwendung von Sicherheiten	Wenn der tatsächliche Wert der wieder verwendeten Sicherheiten nicht bekannt ist oder nicht berechnet werden kann, ist ein Schätzwert auf Ebene der einzelnen Finanzinstrumente nach Maßgabe des FSB-Berichts „Transforming Shadow Banking into Resilient Market-based Finance, Non-Cash Collateral Re-Use: Measure and Metrics“ vom 25. Januar 2017 einzufügen.	Y	Y	Y	Y
10	Währung weiterverwendeter Sicherheiten	Währung des tatsächlichen oder geschätzten Werts der weiterverwendeten Sicherheiten.	Y	Y	Y	Y
11	Reinvestierungsquote	Bei Reinvestition von Barsicherheiten durch den Verleiher erhaltener durchschnittlicher Zinssatz.	N	N	Y	N

Die Felder 12, 13 und 14 sind für jede Investition, bei der Barsicherheiten reinvestiert wurden, und für jede Währung auszufüllen.

12	Art der reinvestierten Barinvestition	Art der Reinvestition.	N	N	Y	N
13	Höhe reinvestierte Barmittel	Höhe reinvestierte Barmittel in einer bestimmten Währung.	N	N	Y	N
14	Währung reinvestierte Barmittel	Währung der reinvestierten Barmittel.	N	N	Y	N

Bei Lombardgeschäften füllt die Gegenpartei die Felder 15, 16 und 17 für jede Finanzierungsquelle erneut aus. Die Angaben erfolgen auf Unternehmensebene.

15	Finanzierungsquellen	Finanzierungsquellen zur Finanzierung von Lombardkrediten.	N	N	N	Y
16	Marktwert der Finanzierungsquellen	Marktwert der in Feld 15 genannten Finanzierungsquellen.	N	N	N	Y
17	Währung Finanzierungsquellen	Währung des Marktwerts der Finanzierungsquellen.	N	N	N	Y
18	Art des Vorgangs	In der Meldung sind folgende Arten von Vorgängen anzugeben: (a) Bei neuem Weiterverwendungssaldo erfolgt die Angabe „neu“;	Y	Y	Y	Y

Nr.	Feld	Zu meldende Angaben	Repo	BSB	SL	ML
		(b) bei Änderungen der Einzelheiten der Weiterverwendung erfolgt die Angabe „Aktualisierung der Weiterverwendung“; c) bei Stornierung einer fehlerhaft eingereichten Meldung erfolgt die Angabe „Fehler“; d) bei Berichtigung von Datenfeldern, die in einer früheren Meldung falsch ausgefüllt wurden, erfolgt die Angabe „Korrektur“.				